



Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €)

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	11.602,9	9.211,2	2.391,7
davon Derivate	-67,0	-	
Barwert	12.742,6	9.762,5	2.980,1
davon Derivate	86,3	-	
Risikobarwert *)	12.417,7	9.523,3	2.894,4

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	13.817,8	10.955,5	2.862,3
davon Derivate	-96,4	-	
Barwert	15.121,6	11.717,6	3.404,0
davon Derivate	146,8	-	
Risikobarwert *)	15.043,8	11.725,0	3.318,8

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €) nach vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	11.602,9	9.211,2	2.391,7
Barwert	12.742,6	9.762,5	2.980,1

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	13.817,8	10.955,5	2.862,3
Barwert	15.121,6	11.717,6	3.404,0

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf
bis zu 6 Monate	897,7	1.465,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	583,1	910,7
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	790,0	1.364,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	837,3	800,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.656,8	1.353,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.929,2	421,0
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.505,7	648,9
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.999,0	2.027,3
mehr als 10 Jahre	404,1	219,3
Total	11.602,9	9.211,2

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	1.567,1	1.226,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	673,3	969,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.066,8	1.466,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	729,4	911,5
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.401,4	2.248,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.889,7	1.245,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.796,7	468,0
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.398,0	2.130,0
mehr als 10 Jahre	295,4	290,1
Total	13.817,8	10.955,5

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio. €)

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	14,6
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	62,5
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	601,4
mehr als 10 Mio. €	10.142,9
Total	10.821,4

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	23,2
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	73,3
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	840,0
mehr als 10 Mio. €	12.045,2
Total	12.981,7

Weitere Deckungswerte gemäß §28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 6 - Detaildarstellung (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 1	Geldforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 2		Schuldverschreibungen nach §19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.D. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	-	-	-	497,5	497,5
EU-Institutionen	-	-	-	5,0	5,0
Frankreich	-	-	-	250,0	250,0
Österreich	-	-	-	96,0	96,0
Total	0,0	0,0	0,0	848,5	848,5

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 1	Geldforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 2		Schuldverschreibungen nach §19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.D. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	-	-	-	253,5	253,5
EU-Institutionen	-	-	-	135,0	135,0
Frankreich	-	-	-	170,0	170,0
Österreich	-	-	-	374,0	374,0
Total	0,0	0,0	0,0	932,5	932,5

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe		9.211,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		59,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		11.602,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt		-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse		42,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 7

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)		5,2	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,5	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		37,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung			
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD			30,6 Mio. €
CHF			10,3 Mio. €
DKK			82,9 Mio. €
EUR			2.674,5 Mio. €
GBP			96,2 Mio. €
NOK			0,5 Mio. €
SEK			-3,9 Mio. €
USD			41,0 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Umlaufende Pfandbriefe		10.955,5	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		51,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		13.817,8	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt		-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse		37,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 7

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)		4,8	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,2	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		39,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung			
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD			26,0 Mio. €
CHF			16,1 Mio. €
CZK			6,9 Mio. €
DKK			115,2 Mio. €
EUR			3.086,4 Mio. €
GBP			101,9 Mio. €
NOK			0,7 Mio. €
SEK			37,3 Mio. €
USD			-30,6 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10