

Hypothekengeschäft -
Übersicht zur Deckungsmasse
gemäß § 28 PfandBG
Stand: 31.03.2011



Aareal Bank

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	9.653,7	7.978,7	1.675,0
davon Derivate	77,0	113,4	
Barwert	10.008,2	8.007,1	2.001,1
davon Derivate	-	2,8	
Risikobarwert)*	10.126,8	8.421,5	1.705,3

Anteil weitere Deckungswerte (Stichtag)

nach §19 Abs. 1 Nr. 2 und 3	592,9
-----------------------------	--------------

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

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	8.818,4	7.171,4	1.647,0
Barwert	9.411,4	7.470,3	1.941,1
davon Derivate	124,7	-	
Risikobarwert)*	9.379,7	7.691,9	1.687,8

Anteil weitere Deckungswerte (Vorjahr)

nach §19 Abs. 1 Nr. 2 und 3	547,9
-----------------------------	--------------

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

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf
bis 1 Jahr	1.631,5	879,3
mehr als 1 bis 2 Jahre	1.578,4	1.446,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.752,3	1.916,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.587,9	1.286,8
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.314,4	388,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.510,8	1.655,3
mehr als 10 Jahre	278,4	406,1
Gesamt	9.653,7	7.978,7

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis 1 Jahr	1.455,8	1.242,3
mehr als 1 bis 2 Jahre	1.347,7	864,9
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.292,0	1.096,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.519,9	948,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.207,9	1.140,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.728,5	1.586,2
mehr als 10 Jahre	266,5	292,6
Gesamt	8.818,4	7.171,4

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	16,1
mehr als 300T€ bis 5 Mio. €	755,7
über 5 Mio. €	8.211,9
Gesamt	8.983,7

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	14,0
mehr als 300T€ bis 5 Mio. €	802,0
über 5 Mio. €	8.002,4
Gesamt	8.818,4

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen nach Land gemäß §28 Abs. 2 PfandBG (Mio €)

Land	
Dänemark	0,2
Italien	0,3
Summe	0,5

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 2 PfandBG (Mio €)

Für den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren keine rückständigen Leistungen von mindestens 90 Tagen.