

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

§28 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 3

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	14.025,2	12.037,3	1.987,9
davon Derivate	95,3	-	
Barwert	14.614,5	12.153,0	2.461,5
davon Derivate	-	88,8	
Risikobarwert ⁽³⁾	14.866,8	13.337,9	1.528,9

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	12.464,3	10.604,0	1.860,3
davon Derivate	60,4	-	
Barwert	13.381,6	11.163,7	2.217,9
davon Derivate	110,0	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	13.445,6	11.521,5	1.924,1

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	14.025,2	12.037,3	1.987,9
Barwert	14.614,5	12.153,0	2.461,5

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	12.464,3	10.604,0	1.860,3
Barwert	13.381,6	11.163,7	2.217,9

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾
bis zu 6 Monate	1.555,7	1.348,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	745,8	1.124,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.286,9	809,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.585,0	944,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.129,5	1.433,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.487,4	1.540,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	2.481,9	868,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.656,9	3.862,3
mehr als 10 Jahre	96,1	106,0
Total	14.025,2	12.037,3

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	812,7	820,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	765,0	539,8
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.340,0	1.346,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	873,3	1.124,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.738,4	1.765,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.155,5	1.417,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.764,5	889,8
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.004,5	2.475,2
mehr als 10 Jahre	10,4	224,7
Total	12.464,3	10.604,0

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300€	171,2
mehr als 300€ bis 1 Mio. €	43,8
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	350,3
mehr als 10 Mio. €	12.173,2
Total	12.738,5

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300€	224,1
mehr als 300€ bis 1 Mio. €	46,2
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	438,2
mehr als 10 Mio. €	10.995,3
Total	11.703,8

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	-	-	-	887,0	887,0
EU-Institutionen	-	-	-	367,0	367,0
Frankreich	-	-	-	53,0	53,0
Spanien	-	-	-	75,0	75,0
Total	-	-	-	1.382,0	1.382,0

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	-	-	-	424,0	424,0
EU-Institutionen	-	-	-	231,0	231,0
Spanien	-	-	-	45,0	45,0
Total	-	-	-	700,0	700,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe ⁽¹⁾	12.037,3	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	80,7	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
Deckungsmasse	14.025,2	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 7
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	54,3	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)	4,7	Jahre	§28 Abs. 1 Nr. 11
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis	55,6	%	§28 Abs. 2 Nr. 3
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	32,6	%	

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung

Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
AUD	135,7	Mio. €
CAD	26,2	Mio. €
CHF	67,9	Mio. €
DKK	51	Mio. €
EUR	285,4	Mio. €
GBP	207,8	Mio. €
SEK	83,3	Mio. €
USD	1.019,0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe ⁽²⁾	10.604,0	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	76,7	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
Deckungsmasse	12.464,3	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 7
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	54,6	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)	4,7	Jahre	§28 Abs. 1 Nr. 11
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis	55,3	%	§28 Abs. 2 Nr. 3
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	33,4	%	

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung

Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
AUD	67,2	Mio. €
CAD	78,0	Mio. €
CHF	13,1	Mio. €
DKK	16,9	Mio. €
EUR	1519,2	Mio. €
GBP	485,4	Mio. €
SEK	56,7	Mio. €
USD	-177,6	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

⁽¹⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 1.123,0 Mio. €

⁽²⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 397,0 Mio. €

⁽³⁾ - dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO