

Hypothekengeschäft -
Übersicht zur Deckungsmasse
gemäß § 28 PfandBG
Stand: 31.12.2010



Aareal Bank

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	9.503,9	8.237,4	1.266,5
davon Derivate	42,1	145,9	
Barwert	10.090,1	8.370,7	1.719,4
davon Derivate	12,7		
Risikobarwert)*	10.175,0	8.670,5	1.504,5

Anteil weitere Deckungswerte (Stichtag)

nach §19 Abs. 1 Nr. 2 und 3	972,9
-----------------------------	--------------

*) 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	9.181,0	7.367,6	1.813,4
Barwert	9.862,2	7.651,2	2.211,0
davon Derivate	189,3	-	
Risikobarwert)*	9.840,9	7.893,0	1.947,9

Anteil weitere Deckungswerte (Vorjahr)

nach §19 Abs. 1 Nr. 2 und 3	1.031,6
-----------------------------	----------------

* 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	1.911,7	1.721,8
mehr als 1 bis 2 Jahre	1.314,1	1.344,7
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.886,1	1.475,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.523,1	813,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.063,8	889,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.516,9	1.586,2
mehr als 10 Jahre	288,2	406,1
Gesamt	9.503,9	8.237,4

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis 1 Jahr	1.329,2	1.196,5
mehr als 1 bis 2 Jahre	1.620,3	1.713,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.253,5	1.059,6
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.343,5	955,8
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.336,8	682,8
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.983,4	1.596,7
mehr als 10 Jahre	314,4	162,6
Gesamt	9.181,0	7.367,6

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	14,7
mehr als 300T€ bis 5 Mio. €	756,1
über 5 Mio. €	7.718,0
Gesamt	8.488,8

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	14,2
mehr als 300T€ bis 5 Mio. €	795,5
über 5 Mio. €	8.371,4
Gesamt	9.181,0

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

Land	
Dänemark	0,2
Frankreich	0,4
Italien	0,1
Spanien	0,2
Summe	0,9

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

Land	
Italien	0,1
Summe	0,1