



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	Überdeckung
Nennwert	14.684,3	11.670,2	3.014,1
davon Derivate	-273,0	-	
Barwert	16.104,9	12.447,3	3.657,6
davon Derivate	-	49,4	
Risikobarwert *)	16.003,5	12.418,2	3.585,3

*) 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	13.492,4	10.770,9	2.721,5
davon Derivate	-219,0	-	
Barwert	14.859,9	11.570,3	3.289,6
davon Derivate	38,3	-	
Risikobarwert *)	14.873,1	11.670,2	3.202,9

*) 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	14.684,3	11.670,2	3.014,1
Barwert	16.104,9	12.447,3	3.657,6

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	13.492,4	10.770,9	2.721,5
Barwert	14.859,9	11.570,3	3.289,6

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	1.313,9	1.463,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.081,5	1.089,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	737,3	1.185,6
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.003,2	839,8
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.229,2	2.302,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	3.041,6	1.850,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	2.158,0	494,9
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.711,1	2.044,0
mehr als 10 Jahre	408,5	399,7
Total	14.684,3	11.670,2

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	886,7	800,9
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	783,2	263,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.160,5	1.388,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.276,3	1.009,0
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.971,2	1.900,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.338,0	1.997,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	2.055,4	1.179,1
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.836,1	1.819,4
mehr als 10 Jahre	185,0	413,2
Total	13.492,4	10.770,9

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	24,9
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	78,0
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	910,3
mehr als 10 Mio. €	12.356,2
Total	13.369,4

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	12,5
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	73,2
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	849,1
mehr als 10 Mio. €	11.341,3
Total	12.276,1

Weitere Deckungswerte gemäß §28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 6 - Detailldarstellung (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	-	-	-	833,9	833,9
EU-Institutionen	-	-	-	160,0	160,0
Frankreich	-	-	-	220,0	220,0
Österreich	-	-	-	374,0	374,0
Total	0,0	0,0	0,0	1.587,9	1.587,9

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	-	-	-	799,4	799,4
EU-Institutionen	-	-	-	286,0	286,0
Frankreich	-	-	-	265,0	265,0
Österreich	-	-	-	85,0	85,0
Total	0,0	0,0	0,0	1.435,4	1.435,4

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe		11.670,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		49,5	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		14.684,3	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		39,8	%

§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)		4,6	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,2	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		39,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung					
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite				
	CAD				25,3
CHF				17,8	Mio. €
CZK				6,9	Mio. €
DKK				78,6	Mio. €
EUR				3.338,6	Mio. €
GBP				119,5	Mio. €
NOK				0,5	Mio. €
SEK				29,1	Mio. €
USD				5,0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe		10.770,9	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		48,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		13.492,4	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		37,3	%

§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)		4,3	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		56,3	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		37,5	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung					
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite				
	CAD				19,8
CHF				-17,7	Mio. €
CZK				12,1	Mio. €
DKK				32,2	Mio. €
EUR				3.088,2	Mio. €
GBP				-0,5	Mio. €
NOK				-4,4	Mio. €
SEK				54,3	Mio. €
USD				57,4	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10