

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	11.809,0	10.316,8	1.492,2
davon Derivate	82,5	-	
Barwert	12.619,8	11.002,7	1.617,1
davon Derivate	158,2	-	
Risikobarwert *)	12.739,6	11.405,8	1.333,8

*) 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	13.082,5	10.043,4	3.039,1
davon Derivate	246,8	-	
Barwert	14.076,3	10.781,4	3.294,9
davon Derivate	333,3	-	
Risikobarwert *)	14.023,2	10.809,4	3.213,8

*) 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	11.809,0	10.316,8	1.492,2
Barwert	12.619,8	11.002,7	1.617,1

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	13.082,5	10.043,4	3.039,1
Barwert	14.076,3	10.781,4	3.294,9

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	1.316,6	897,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	761,4	540,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	943,0	1.092,6
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	544,2	308,7
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.974,8	885,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.777,4	2.499,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.806,5	1.727,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.656,0	2.044,4
mehr als 10 Jahre	29,1	320,4
Total	11.809,0	10.316,8

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	876,9	1.609,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.544,5	1.164,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.397,6	858,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.036,9	540,5
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.655,8	1.347,0
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.015,4	815,4
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.476,7	1.463,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.832,4	1.843,5
mehr als 10 Jahre	246,3	402,1
Total	13.082,5	10.043,4

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	376,5
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	75,1
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	525,0
mehr als 10 Mio. €	10.033,9
Total	11.010,5

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	572,3
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	90,0
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	654,8

mehr als 10 Mio. €	9.513,4
Total	10.830,5

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	-	-	-	521,0	521,0
EU-Institutionen	-	-	-	60,0	60,0
Frankreich	-	-	-	135,0	135,0
Total	0,0	0,0	0,0	716,0	716,0

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	-	-	-	1.563,2	1.563,2
EU-Institutionen	-	-	-	271,0	271,0
Frankreich	-	-	-	75,0	75,0
Österreich	-	-	-	96,0	96,0
Total	0,0	0,0	0,0	2.005,2	2.005,2

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe	10.316,8	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	70,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	11.809,0	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	53,0	%

§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)	5,3	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungsbasis	56,4	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	35,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung	
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD	28,0 Mio. €
CHF	15,0 Mio. €
DKK	74,7 Mio. €
EUR	786,0 Mio. €
GBP	417,2 Mio. €
SEK	21,5 Mio. €
USD	71,7 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe	10.043,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	65,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	13.082,5	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	52,2	%

§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)	5,8	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungsbasis	56,2	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	36,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung	
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD	8,7 Mio. €
CHF	14,6 Mio. €
DKK	21,3 Mio. €
EUR	3.122,7 Mio. €
GBP	33,5 Mio. €
SEK	32,4 Mio. €
USD	0,5 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10