



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	15.175,5	12.142,6	3.032,9
davon Derivate	-530,9	-	
Barwert	16.691,5	13.162,4	3.529,1
davon Derivate	-	318,5	
Risikobarwert *)	16.689,6	13.343,7	3.345,9

*) 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	13.241,3	10.560,5	2.680,8
davon Derivate	-16,0	-	
Barwert	14.322,7	11.245,8	3.076,9
davon Derivate	197,4	-	
Risikobarwert *)	14.448,4	11.489,0	2.959,4

*) 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	15.175,5	12.142,6	3.032,9
Barwert	16.691,5	13.162,4	3.529,1

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	13.241,3	10.560,5	2.680,8
Barwert	14.322,7	11.245,8	3.076,9

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	1.203,4	418,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.109,1	1.480,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.198,1	1.110,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	945,6	1.185,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.403,2	2.375,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.644,6	2.073,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	2.335,0	906,2
mehr als 5 bis 10 Jahre	3.185,9	2.124,2
mehr als 10 Jahre	150,6	468,4
Total	15.175,5	12.142,6

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	1.385,2	608,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	812,2	800,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	829,5	348,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.213,4	1.394,8
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.067,2	2.070,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.443,9	1.793,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.939,6	949,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.325,2	2.223,9
mehr als 10 Jahre	225,1	370,5
Total	13.241,3	10.560,5

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	31,5
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	89,1
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	1.038,2
mehr als 10 Mio. €	13.767,2
Total	14.926,0

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	13,9
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	74,6
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	1.038,1
mehr als 10 Mio. €	10.905,2
Total	12.031,8

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	-	-	-	457,4	457,4
EU-Institutionen	-	-	-	110,0	110,0
Frankreich	-	-	-	125,0	125,0
Österreich	-	-	-	88,0	88,0
Total	0,0	0,0	0,0	780,4	780,4

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	-	-	-	561,7	561,7
EU-Institutionen	-	-	-	298,5	298,5
Frankreich	-	-	-	285,0	285,0
Österreich	-	-	-	80,2	80,2
Total	0,0	0,0	0,0	1.225,4	1.225,4

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe		12.142,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		49,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		15.175,5	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		35,8	%

§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)		4,5	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,3	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		40,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettoarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung						
Währung					Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
	CAD				18,6	Mio. €
CHF				-9,9	Mio. €	
CZK				-2,8	Mio. €	
DKK				43,4	Mio. €	
EUR				3.259,8	Mio. €	
GBP				81,4	Mio. €	
JPY				111,4	Mio. €	
NOK				1,3	Mio. €	
SEK				5,7	Mio. €	
USD				-100,6	Mio. €	

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe		10.560,5	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		45,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		13.241,3	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		38,4	%

§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)		4,2	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		56,0	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		36,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettoarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung						
Währung					Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
	CAD				13,4	Mio. €
CHF				-16,9	Mio. €	
CZK				-2,8	Mio. €	
DKK				8,9	Mio. €	
EUR				2.883,3	Mio. €	
GBP				-49,8	Mio. €	
JPY				-12,8	Mio. €	
NOK				-4,7	Mio. €	
SEK				86,1	Mio. €	
USD				102,0	Mio. €	

§28 Abs. 1 Nr. 10