



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	12.938,0	10.194,3	2.743,7
davon Derivate	-65,3	-	
Barwert	14.171,4	10.948,8	3.222,6
davon Derivate	161,4	-	
Risikobarwert *)	14.052,9	10.997,0	3.055,9

*) 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	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

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	12.938,0	10.194,3	2.743,7
Barwert	14.171,4	10.948,8	3.222,6

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	15.175,5	12.142,6	3.032,9
Barwert	16.691,5	13.162,4	3.529,1

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	1.104,9	1.087,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	671,9	1.183,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.012,8	837,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	735,3	1.504,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.615,4	2.041,0
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.478,3	891,2
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.730,4	279,2
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.453,2	2.030,0
mehr als 10 Jahre	135,8	340,0
Total	12.938,0	10.194,3

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
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

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	19,7
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	73,8
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	754,9
mehr als 10 Mio. €	11.452,4
Total	12.300,8

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
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

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	-	-	-	338,5	338,5
EU-Institutionen	-	-	-	90,0	90,0
Frankreich	-	-	-	145,0	145,0
Österreich	-	-	-	129,0	129,0
Total	0,0	0,0	0,0	702,5	702,5

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	-	-	-	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

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe		10.194,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		54,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		12.938,0	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		38,7	%

§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)		4,9	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,6	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		38,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung					
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite				
	CAD				27,5
CHF				17,7	Mio. €
CZK				6,9	Mio. €
DKK				77,0	Mio. €
EUR				2.582,7	Mio. €
GBP				323,3	Mio. €
NOK				0,7	Mio. €
SEK				59,5	Mio. €
USD				28,8	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

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

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung					
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite				
	CAD				18,6
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