

Hypothekengeschäft -
Übersicht zur Deckungsmasse
gemäß § 28 PfandBG
Stand: 30.09.2008



Aareal Bank

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	6.941,0	6.133,5	807,5
Barwert	7.183,3	6.163,0	1.020,3
davon Derivate	39,1	15,2	

	Stichtag
Anteil weitere Deckungswerte	249,3
Risikobarwert der Überdeckung	870,5

* 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	5.250,9	4.240,2	1.010,7
Barwert	5.417,4	4.231,4	1.186,0
davon Derivate	10,7	17,0	

	Vorjahr
Anteil weitere Deckungswerte	310,2
Risikobarwert der Überdeckung	1.050,2

* 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	1.032,6	1.088,8
mehr als 1 bis 5 Jahre	3.761,9	3.839,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.030,1	1.070,3
mehr als 10 Jahre	116,4	135,0
Gesamt	6.941,0	6.133,5

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis 1 Jahr	478,3	262,5
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.949,0	2.760,0
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.551,0	1.197,7
mehr als 10 Jahre	272,6	20,0
Gesamt	5.250,9	4.240,2

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	9,1
mehr als 300T€ bis 5 Mio. €	691,0
über 5 Mio. €	6.249,0
Gesamt	6.941,0

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	125,3
mehr als 300T€ bis 5 Mio. €	567,7
über 5 Mio. €	4.558,0
Gesamt	5.250,9

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.