



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	13.903,3	10.589,2	3.314,1
davon Derivate	159,4	-	
Barwert	14.999,7	11.458,4	3.541,3
davon Derivate	282,4	-	
Risikobarwert *)	15.250,3	11.857,6	3.392,7

*) 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	12.430,0	9.639,2	2.790,8
davon Derivate	6,6	-	
Barwert	13.700,3	10.366,4	3.333,9
davon Derivate	226,1	-	
Risikobarwert *)	13.544,2	10.393,4	3.150,8

*) 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	13.903,3	10.589,2	3.314,1
Barwert	14.999,7	11.458,4	3.541,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	12.430,0	9.639,2	2.790,8
Barwert	13.700,3	10.366,4	3.333,9

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	931,5	1.278,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	924,7	1.618,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.630,3	1.164,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.467,7	875,7
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.190,2	1.314,9
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.162,6	607,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.619,2	1.579,8
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.826,9	1.713,5
mehr als 10 Jahre	150,2	437,3
Total	13.903,3	10.589,2

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	1.282,0	969,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	584,0	1.465,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	632,2	911,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	854,2	1.354,8
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.511,8	1.714,0
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.294,9	700,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.861,7	398,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.107,0	1.869,4
mehr als 10 Jahre	302,2	256,0
Total	12.430,0	9.639,2

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	692,0
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	103,1
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	758,4
mehr als 10 Mio. €	10.469,1
Total	12.022,6

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	17,9
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	63,1
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	691,2
mehr als 10 Mio. €	10.782,9
Total	11.555,1

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	-	-	-	1.260,8	1.260,8
EU-Institutionen	-	-	-	244,5	244,5
Frankreich	-	-	-	120,0	120,0
Österreich	-	-	-	96,0	96,0
Total	0,0	0,0	0,0	1.721,3	1.721,3

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	-	-	-	564,3	564,3
EU-Institutionen	-	-	-	30,0	30,0
Frankreich	-	-	-	145,0	145,0
Österreich	-	-	-	129,0	129,0
Total	0,0	0,0	0,0	868,3	868,3

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe		10.589,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		66,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		13.903,3	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		48,2	%

§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)		5,9	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		56,2	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		37,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD				14,4 Mio. €
CHF				16,5 Mio. €
DKK				58,6 Mio. €
EUR				3.003,6 Mio. €
GBP				200,2 Mio. €
SEK				25,5 Mio. €
USD				142,7 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe		9.639,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		56,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		12.430,0	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		37,7	%

§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)		5,0	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,4	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		38,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD				25,8 Mio. €
CHF				16,6 Mio. €
CZK				6,9 Mio. €
DKK				81,5 Mio. €
EUR				2.623,4 Mio. €
GBP				304,5 Mio. €
NOK				0,6 Mio. €
SEK				8,3 Mio. €
USD				174,5 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10