

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 ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	12.443,3	10.861,7	1.581,6
davon Derivate	129,5	-	
Barwert	13.378,3	11.644,4	1.733,9
davon Derivate	225,2	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	13.602,2	12.142,0	1.460,2

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	11.858,2	9.122,1	2.736,1
davon Derivate	190,6	-	
Barwert	12.648,4	9.815,1	2.833,3
davon Derivate	263,8	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	12.821,2	10.157,8	2.663,4

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	12.443,3	10.861,7	1.581,6
Barwert	13.378,3	11.644,4	1.733,9

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	11.858,2	9.122,1	2.736,1
Barwert	12.648,4	9.815,1	2.833,3

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾
bis zu 6 Monate	1.156,8	617,9
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	750,5	697,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	897,1	744,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	783,1	218,2
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.098,7	2.041,6
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.385,5	1.977,8
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.736,6	1.596,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.604,7	2.693,2
mehr als 10 Jahre	30,3	275,2
Total	12.443,3	10.861,7

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	1.211,6	825,9
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.465,8	1.595,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.156,9	602,9
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	491,0	700,7
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.834,4	939,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	1.766,3	1.152,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.186,6	1.232,9
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.722,4	1.730,4
mehr als 10 Jahre	23,2	342,6
Total	11.858,2	9.122,1

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	349,7
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	71,6
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	526,5
mehr als 10 Mio. €	9.784,0
Total	10.731,8

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	525,7
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	85,9
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	627,6
mehr als 10 Mio. €	9.501,9

Total	10.741,1
-------	----------

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	-	-	-	1.348,0	1.348,0
EU-Institutionen	-	-	-	70,0	70,0
Frankreich	-	-	-	135,0	135,0
Österreich	-	-	-	29,0	29,0
Total	0,0	0,0	0,0	1.582,0	1.582,0

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	-	-	-	836,5	836,5
EU-Institutionen	-	-	-	40,0	40,0
Frankreich	-	-	-	25,0	25,0
Österreich	-	-	-	25,0	25,0
Total	0,0	0,0	0,0	926,5	926,5

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe ⁽¹⁾	10.861,7	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	74,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	12.443,3	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	54,9	%

§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 Beleihungswertbasis	55,6	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	34,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung	
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD	77,8 Mio. €
CHF	15,2 Mio. €
DKK	-16,9 Mio. €
EUR	1.287,4 Mio. €
GBP	192,2 Mio. €
SEK	21,7 Mio. €
USD	-61,2 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe ⁽²⁾	9.122,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	67,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	11.858,2	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	50,4	%

§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)	5,7	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis	56,0	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	36,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung	
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD	7,5 Mio. €
CHF	14,1 Mio. €
DKK	17,1 Mio. €
EUR	2.384,4 Mio. €
GBP	292,1 Mio. €
SEK	23,6 Mio. €
USD	-28,6 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

⁽¹⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0 Mio. €

⁽²⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0 Mio. €

⁽³⁾ - dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO