



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

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

\*) 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
<b>Nennwert</b>	15.175,5	12.142,6	<b>3.032,9</b>
<b>Barwert</b>	16.691,5	13.162,4	<b>3.529,1</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

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

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
<b>Total</b>	<b>15.175,5</b>	<b>12.142,6</b>

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
<b>Total</b>	<b>13.241,3</b>	<b>10.560,5</b>

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
<b>Total</b>	<b>14.926,0</b>

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
<b>Total</b>	<b>12.031,8</b>

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
<b>Total</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>780,4</b>	<b>780,4</b>

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
<b>Total</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>1.225,4</b>	<b>1.225,4</b>

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>		12.142,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		49,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>		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 Beleihungsbasis		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

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>		10.560,5	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		45,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>		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 Beleihungsbasis		56,0	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		36,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung					
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite				
	CAD				13,4
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