



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>	14.606,6	10.701,6	<b>3.905,0</b>
davon Derivate	83,9	-	
<b>Barwert</b>	15.818,6	11.599,0	<b>4.219,6</b>
davon Derivate	211,3	-	
<b>Risikobarwert *)</b>	15.703,0	11.629,0	<b>4.074,0</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>	12.938,0	10.194,3	<b>2.743,7</b>
davon Derivate	-65,3	-	
<b>Barwert</b>	14.171,4	10.948,8	<b>3.222,6</b>
davon Derivate	161,4	-	
<b>Risikobarwert *)</b>	14.052,9	10.997,0	<b>3.055,9</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>	14.606,6	10.701,6	<b>3.905,0</b>
<b>Barwert</b>	15.818,6	11.599,0	<b>4.219,6</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	12.938,0	10.194,3	<b>2.743,7</b>
<b>Barwert</b>	14.171,4	10.948,8	<b>3.222,6</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	1.196,4	1.162,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	994,2	1.748,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.175,4	830,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.612,7	1.604,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.785,7	1.021,6
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.072,6	403,0
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.983,4	1.142,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.377,9	2.338,5
mehr als 10 Jahre	408,3	449,8
<b>Total</b>	<b>14.606,6</b>	<b>10.701,6</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
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
<b>Total</b>	<b>12.938,0</b>	<b>10.194,3</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€	745,0
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	107,0
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	812,1
mehr als 10 Mio. €	11.096,7
<b>Total</b>	<b>12.760,8</b>

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
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
<b>Total</b>	<b>12.300,8</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	-	51,0	-	1.235,0	1.286,0
EU-Institutionen	-	-	-	160,0	160,0
Frankreich	-	-	-	120,0	120,0
Österreich	-	-	-	196,0	196,0
<b>Total</b>	<b>0,0</b>	<b>51,0</b>	<b>0,0</b>	<b>1.711,0</b>	<b>1.762,0</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	-	-	-	338,5	338,5
EU-Institutionen	-	-	-	90,0	90,0
Frankreich	-	-	-	145,0	145,0
Österreich	-	-	-	129,0	129,0
<b>Total</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>702,5</b>	<b>702,5</b>

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>		10.701,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		69,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>		14.606,6	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		45,3	%

§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)		6,0	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		55,9	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		37,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung			
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CAD			27,7 Mio. €
CHF			11,9 Mio. €
DKK			76,3 Mio. €
EUR			3.489,7 Mio. €
GBP			274,2 Mio. €
NOK			-5,0 Mio. €
SEK			-7,3 Mio. €
USD			315,8 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>		10.194,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		54,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>		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 Mio. €
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