

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 <sup>(1)</sup>	Überdeckung
<b>Nennwert</b>	13.873,0	11.579,5	<b>2.293,5</b>
davon Derivate	- 60,3	-	
<b>Barwert</b>	14.741,6	12.041,6	<b>2.700,0</b>
davon Derivate	-	47,3	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	14.588,6	12.395,3	<b>2.193,3</b>

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	12.390,8	10.590,6	<b>1.800,2</b>
davon Derivate	204,1	-	
<b>Barwert</b>	13.335,9	11.282,6	<b>2.053,3</b>
davon Derivate	261,5	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	13.294,7	11.663,7	<b>1.631,0</b>

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>	Überdeckung
<b>Nennwert</b>	13.873,0	11.579,5	<b>2.293,5</b>
<b>Barwert</b>	14.741,6	12.041,6	<b>2.700,0</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	12.390,8	10.590,6	<b>1.800,2</b>
<b>Barwert</b>	13.335,9	11.282,6	<b>2.053,3</b>

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>
bis zu 6 Monate	1.209,4	995,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.238,9	881,8
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.246,1	1.065,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.706,8	733,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.220,0	1.444,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.607,3	2.090,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.974,4	979,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.661,1	3.283,4
mehr als 10 Jahre	9,0	106,0
<b>Total</b>	<b>13.873,0</b>	<b>11.579,5</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	728,9	318,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.050,0	1.026,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	961,0	976,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.148,5	881,8
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.548,9	1.810,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.281,5	1.484,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.881,3	833,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.780,2	3.038,3
mehr als 10 Jahre	10,5	221,1
<b>Total</b>	<b>12.390,8</b>	<b>10.590,6</b>

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

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300€	181,6
mehr als 300€ bis 1 Mio. €	44,9
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	386,4
mehr als 10 Mio. €	12.170,4
<b>Total</b>	<b>12.783,3</b>

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

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300€	241,1
mehr als 300€ bis 1 Mio. €	50,8
mehr als 1 Mio.€ bis 10 Mio. €	426,4
mehr als 10 Mio. €	10.768,4
<b>Total</b>	<b>11.486,7</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	-	-	-	778,0	<b>778,0</b>
EU-Institutionen	-	-	-	297,0	<b>297,0</b>
Spanien	-	-	-	75,0	<b>75,0</b>
<b>Total</b>	-	-	-	1.150,0	1.150,0

## 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	-	-	-	419,0	<b>419,0</b>
EU-Institutionen	-	-	-	281,0	<b>281,0</b>
<b>Total</b>	-	-	-	700,0	700,0

## Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(1)</sup>	11.579,5	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	78,3	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	13.873,0	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 7
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	52,8	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)	4,7	Jahre	§28 Abs. 1 Nr. 11
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis	55,5	%	§28 Abs. 2 Nr. 3
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	33,4	%	

## Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung

Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite		
		Mio. €	
AUD	130,2	Mio. €	
CAD	183,2	Mio. €	
CHF	68,5	Mio. €	
DKK	37,7	Mio. €	
EUR	823,1	Mio. €	
GBP	142,2	Mio. €	
SEK	84,1	Mio. €	
USD	1076,8	Mio. €	

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(2)</sup>	10.590,6	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	67,7	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	12.390,8	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 7
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	52,1	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)	4,7	Jahre	§28 Abs. 1 Nr. 11
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis	55,5	%	§28 Abs. 2 Nr. 3
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	33,9	%	

§28 Abs. 1 Nr. 10

## Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung

Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite		
		Mio. €	
AUD	64,0	Mio. €	
CAD	110,0	Mio. €	
CHF	19,3	Mio. €	
DKK	17,1	Mio. €	
EUR	518,7	Mio. €	
GBP	513,2	Mio. €	
SEK	36,2	Mio. €	
USD	571,4	Mio. €	

<sup>(1)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: 1.239,0 Mio. €

<sup>(2)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: 1.359,5 Mio. €

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