

## 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>	12.443,3	10.861,7	<b>1.581,6</b>
davon Derivate	129,5	-	
<b>Barwert</b>	13.378,3	11.644,4	<b>1.733,9</b>
davon Derivate	225,2	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	<b>13.602,2</b>	<b>12.142,0</b>	<b>1.460,2</b>

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	11.858,2	9.122,1	<b>2.736,1</b>
davon Derivate	190,6	-	
<b>Barwert</b>	12.648,4	9.815,1	<b>2.833,3</b>
davon Derivate	263,8	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	<b>12.821,2</b>	<b>10.157,8</b>	<b>2.663,4</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>	12.443,3	10.861,7	<b>1.581,6</b>
<b>Barwert</b>	13.378,3	11.644,4	<b>1.733,9</b>

## Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	11.858,2	9.122,1	<b>2.736,1</b>
<b>Barwert</b>	12.648,4	9.815,1	<b>2.833,3</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	1.156,8	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
<b>Total</b>	<b>12.443,3</b>	<b>10.861,7</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
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
<b>Total</b>	<b>11.858,2</b>	<b>9.122,1</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€	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
<b>Total</b>	<b>10.731,8</b>

## 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
<b>Total</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>1.582,0</b>	<b>1.582,0</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	-	-	-	836,5	836,5
EU-Institutionen	-	-	-	40,0	40,0
Frankreich	-	-	-	25,0	25,0
Österreich	-	-	-	25,0	25,0
<b>Total</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>926,5</b>	<b>926,5</b>

#### Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe <sup>(1)</sup></b>	10.861,7	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	74,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>	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

<b>Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung</b>	
<b>Währung</b>	<b>Saldo aus Aktiv-/ Passivseite</b>
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. €)

<b>Umlaufende Pfandbriefe <sup>(2)</sup></b>	9.122,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	67,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>	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

<b>Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung</b>	
<b>Währung</b>	<b>Saldo aus Aktiv-/ Passivseite</b>
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

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

<sup>(2)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0 Mio. €

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