



Hypothekargeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß § 28 PfandBG

Stand: 31.12.2007

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	5.641,0	4.714,0	927,0
Barwert	5.866,5	4.749,0	1.117,5
davon Derivate	27,5	7,9	

Stichtag

Anteil weitere Deckungswerte 403,5

Risikobarwert* der Überdeckung 983,3

* dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe in Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	4.271,7	3.119,3	1.152,4
Barwert	4.434,2	3.172,8	1.261,4
davon Derivate	-	5,0	

Vorjahr

Anteil weitere Deckungswerte 501,0

Risikobarwert* der Überdeckung 1.125,8

* dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	535,2	417,6
mehr als 1 bis 5 Jahre	3.189,2	2.824,2
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.724,8	1.347,3
mehr als 10 Jahre	191,8	125,0
Total	5.641,0	4.714,0

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	309,9	171,6
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.331,5	1.782,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.444,7	1.165,0
mehr als 10 Jahre	185,6	0,0
Total	4.271,7	3.119,3

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	116,5
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	565,7
über 5 Mio. €	4.958,8
Total	5.641,0

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	167,0
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	516,2
über 5 Mio. €	3.588,5
Total	4.271,7

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch für den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.