



Hypothekargeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß § 28 PfandBG

Stand: 30.09.2007

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	5.250,9	4.240,2	1.010,7
Barwert	5.417,4	4.231,4	1.186,0
davon Derivate	10,7	17,0	

	Stichtag
Anteil weitere Deckungswerte	310,2
Risikobarwert* der Überdeckung	1.050,2

* 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	4.011,4	2.949,2	1.062,2
Barwert	4.196,1	3.020,3	1.175,7
davon Derivate	-	1,7	

	Vorjahr
Anteil weitere Deckungswerte	563,3
Risikobarwert* der Überdeckung	1.067,6

* 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	478,3	262,5
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.949,0	2.760,0
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.551,0	1.197,7
mehr als 10 Jahre	272,6	20,0
Total	5.250,9	4.240,2

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	247,2	131,6
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.085,6	1.635,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.492,4	1.181,9
mehr als 10 Jahre	186,2	0,0
Total	4.011,4	2.949,2

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	125,3
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	567,7
über 5 Mio. €	4.558,0
Total	5.250,9

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	177,9
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	518,8
über 5 Mio. €	3.314,7
Total	4.011,4

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