

Umlaufende Hypothekendarlehen und dafür verwendete Deckungswerte (Stand 31.12.2009) in Mio €

	Nominal	Barwert	Risikobarwert
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen			
Hypothekendarlehen	22.012,6	23.164,1	21.689,5
Deckungsmasse	24.786,5	26.567,4	24.876,1
Überdeckung	2.773,9	3.403,3	3.186,6

	bis 1 Jahr	>1 Jahr - 2 Jahre	>2 Jahre - 3 Jahre	>3 Jahre - 4 Jahre
Laufzeitstruktur (Restlaufzeit) Nominal				
Hypothekendarlehen	4.032,4	3.720,7	4.054,3	2.063,3
Deckungsmasse	13.975,6	2.126,2	1.451,9	1.270,9

	>4 Jahre - 5 Jahre	>5 Jahr - 10 Jahre	>10 Jahre	Gesamt
Laufzeitstruktur (Restlaufzeit) Nominal				
Hypothekendarlehen	2.232,9	2.887,8	3.021,2	22.012,6
Deckungsmasse	1.939,8	3.515,5	506,6	24.786,5

	Barwert	in %
Anteil der Derivate		
Hypothekendarlehen	23.164,1	
davon Derivate	64,3	0,28%
Deckungsmasse	26.567,4	
davon Derivate	403,6	1,52%

Summenanteil weiterer Deckungswerte in der Deckungsmasse	Nominal	in %
nach §19 Abs.1 Nr.2 (Geldforderungen und Werte nach §4 Abs.1 Satz 2 Nr.1 und 2 PfandBG)	0,0	0,0
nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 (Schuldverschreibungen)	2.548,4	10,3

Nach §28 Pfandbriefgesetz (PfandBG) sind im Umlauf befindliche Hypothekendarlehen nach ihrer Laufzeitstruktur darzustellen während die Deckungsmassen nach Zinsbindungsfrist anzugeben sind. Durch die unterschiedliche Gliederungssystematik können temporäre Inkongruenzen in den einzelnen Laufzeitbändern entstehen, die im Rahmen der Gesamtbanksteuerung ausgeglichen werden.

Beim Risikobarwert wird der dynamische Ansatz verwandt.

Umlaufende öffentliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte (Stand 31.12.09) in Mio €

	Nominal	Barwert	Risikobarwert
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen			
öffentlichen Pfandbriefe	53.159,8	56.661,6	48.159,8
Deckungsmasse	59.023,5	64.660,3	54.958,3
Überdeckung	5.863,7	7.998,7	6.798,5

	bis 1 Jahr	>1 Jahr - 2 Jahre	>2 Jahre - 3 Jahre	>3 Jahre - 4 Jahre
Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)				
öffentlichen Pfandbriefe	14.935,5	5.242,6	3.903,3	5.471,5
Deckungsmasse	20.896,4	3.197,7	4.233,2	3.203,4

	>4 Jahre - 5 Jahre	>5 Jahr - 10 Jahre	>10 Jahre	Gesamt
Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)				
öffentlichen Pfandbriefe	2.106,6	10.162,2	11.338,1	53.159,8
Deckungsmasse	1.751,3	11.131,5	14.610,0	59.023,5

	Barwert	in %
Anteil der Derivate		
öffentlichen Pfandbriefe	56.661,6	
davon Derivate	106,6	0,19%
Deckungsmasse	64.660,3	
davon Derivate	528,8	0,82%

Summenanteil weiterer Deckungswerte in der Deckungsmasse	Nominal	in %
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 (Geldforderungen und Werte nach §4 Abs.1 Satz 2 Nr. 1 und 2 PfandBG)	1.980,0	3,4

Nach §28 Pfandbriefgesetz sind im Umlauf befindliche öffentliche Pfandbriefe nach ihrer Laufzeitstruktur darzustellen, während die Deckungsmassen nach Zinsbindungsfrist anzugeben sind. Durch die unterschiedliche Gliederungssystematik können temporäre Inkongruenzen in den einzelnen Laufzeitbändern entstehen, die im Rahmen der Gesamtbanksteuerung ausgeglichen werden.

Beim Risikobarwert wird der dynamische Ansatz verwandt.