

Stichtag	II 2018
Referenz	II 2017

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	250,00	270,00	277,88	300,70	244,74	263,76	318,99	311,55
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	729,28	645,52	808,23	722,93	703,13	628,62	939,77	749,42
davon gattungsklassische Deckungswerte	694,28	610,52	772,60	687,50	672,27	598,63	898,39	712,49
davon weitere Deckungswerte	35,00	35,00	35,63	35,43	30,86	29,98	41,39	36,92
Überdeckung in %	191,71%	139,08%	190,86%	140,42%	187,29%	138,33%	194,60%	140,55%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			5,45%					

II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur II 2018		Laufzeitstruktur II 2017		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2018	II 2017
bis zu sechs Monate	21,26	10,00	16,94	10,00	11,26	6,94
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	16,10	5,00	14,62	20,00	11,10	-5,38
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	22,73	0,00	14,46	10,00	22,73	4,46
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	29,91	10,00	16,19	5,00	19,91	11,19
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	70,19	40,00	58,34	10,00	30,19	48,34
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	63,46	50,00	69,92	40,00	13,46	29,92
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	74,33	30,00	61,00	50,00	44,33	11,00
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	325,30	65,00	309,27	65,00	260,30	244,27
über 10 Jahre	105,99	40,00	84,79	60,00	65,99	24,79

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statistischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung nach	II 2018				II 2017				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		§19 Abs.1 Nr 3 PfandBG 20%-Grenze		Summe	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	35,00	35,00	35,00	35,00
Summe	-	-	-	-	35,00	35,00	35,00	35,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
keine	-	-	-	-	-	-

	II 2018	II 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,25%	99,19%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	98,00%	98,15%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,32%	54,27%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,35	4,44

Stichtag	II 2018
Referenz	II 2017

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	II 2018	II 2017	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	II 2018	II 2017	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	632,14	554,32		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	35,00	14,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	43,64	37,53		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	18,50	18,67		davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%
mehr als 10 Mio.€	-	-		Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	15,00	15,00	6,00%
wohnwirtschaftlich	656,67	572,39		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. la PfandBG	20,00	20,00	8,00%
gewerblich	37,61	38,13		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	729,28	645,52	291,71%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	92,69	84,90	12,71%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	468,22	402,51	64,20%				
Mehrfamilienhäuser	95,76	84,98	13,13%				
Bürogebäude	6,31	6,34	0,86%				
Handelsgebäude	1,67	2,01	0,23%				
Industriegebäude	20,77	20,82	2,85%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	8,85	8,96	1,21%				
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%				
Bauplätze	-	-	0,00%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 2 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00