

Stichtag	I 2019
Referenz	I 2018

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)	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	240,00	270,00	268,20	296,94	238,35	262,54	303,98	339,72
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	778,64	709,23	872,31	784,32	758,46	682,97	1.011,53	910,95
davon gattungsklassische Deckungswerte	743,64	674,23	836,08	748,92	726,57	652,48	970,27	869,59
davon weitere Deckungswerte	35,00	35,00	36,23	35,40	31,89	30,49	41,26	41,36
Überdeckung in %	224,43%	162,68%	225,24%	164,14%	218,21%	160,14%	232,76%	168,15%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,75%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2019		Laufzeitstruktur I 2018		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2019	I 2018
bis zu sechs Monate	24,36	5,00	21,07	25,00	19,36	-3,93
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	27,78	10,00	16,42	5,00	17,78	11,42
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	35,45	0,00	18,82	5,00	35,45	13,82
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	32,30	30,00	32,27	10,00	2,30	22,27
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	62,84	60,00	70,70	30,00	2,84	40,70
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	71,82	30,00	63,39	60,00	41,82	3,39
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	66,92	15,00	65,40	30,00	51,92	35,40
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	330,34	60,00	321,94	55,00	270,34	266,94
über 10 Jahre	126,82	30,00	99,21	50,00	96,82	49,21

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	I 2019				I 2018				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	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
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	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
keine	-	-	-	-	-	-

	I 2019	I 2018
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,27%	99,20%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	97,92%	98,15%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,33%	54,32%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,59	4,31

Stichtag	I 2019
Referenz	I 2018

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2019	I 2018	Anteil am Gesamtbeitrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	I 2019	I 2018	Anteil am Gesamtbeitrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	679,53	611,85		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	35,00	14,58%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	47,23	43,83		davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	16,88	18,54		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	6,25%
wohnwirtschaftlich	707,96	636,43		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	20,00	20,00	8,33%
gewerblich	35,67	37,80		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	778,64	709,23	324,43%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	99,07	91,40	12,72%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	510,18	451,46	65,52%				
Mehrfamilienhäuser	98,71	93,57	12,68%				
Bürogebäude	5,71	6,40	0,73%				
Handelsgebäude	1,44	1,75	0,18%				
Industriegebäude	17,81	21,15	2,29%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	10,72	8,51	1,38%				
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	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00