

Stichtag	III 2018
Referenz	III 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)	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	245,00	270,00	271,51	301,26	240,09	263,64	310,34	312,09
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	741,62	667,43	814,24	746,02	709,60	649,14	945,07	772,94
davon gattungsklassische Deckungswerte	706,62	632,43	778,92	710,60	678,83	619,01	904,28	736,18
davon weitere Deckungswerte	35,00	35,00	35,31	35,42	30,77	30,14	40,78	36,76
Überdeckung in %	202,70%	147,20%	199,89%	147,63%	195,56%	146,22%	204,52%	147,66%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,52%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2018		Laufzeitstruktur III 2017		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2018	III 2017
bis zu sechs Monate	22,67	5,00	16,69	0,00	17,67	16,69
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	18,37	5,00	16,97	0,00	13,37	-8,03
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	27,53	10,00	15,78	5,00	17,53	10,78
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	36,67	0,00	18,85	5,00	36,67	13,85
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	66,00	40,00	71,34	10,00	26,00	61,34
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	62,02	60,00	65,52	40,00	2,02	25,52
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	70,35	20,00	59,86	60,00	50,35	-0,14
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	327,30	65,00	316,25	65,00	262,30	251,25
über 10 Jahre	110,72	40,00	86,18	60,00	70,72	26,18

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	III 2018				III 2017				gesetzl. Grenze
	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert 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	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 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	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
keine	-	-	-	-	-	-

	III 2018	III 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,24%	99,23%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	97,96%	98,15%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,23%	54,29%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sicher gestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,46	4,52

Stichtag	III 2018
Referenz	III 2017

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	III 2018	III 2017	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	III 2018	III 2017	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	644,46	572,20		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	35,00	14,29%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	43,72	41,59		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	18,45	18,64		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	6,12%
wohnwirtschaftlich	669,65	593,96		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. la PfandBG	20,00	20,00	8,16%
gewerblich	36,98	38,47		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	741,62	667,43	302,70%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	95,06	87,16	12,82%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	478,79	419,36	64,56%				
Mehrfamilienhäuser	95,80	87,44	12,92%				
Bürogebäude	6,21	6,45	0,84%				
Handelsgebäude	1,60	1,94	0,22%				
Industriegebäude	20,38	21,16	2,75%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	8,79	8,93	1,18%				
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	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00