

Stichtag	I 2018
Referenz	I 2017

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert*	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	4.664	3.202	4.737	3.311	4.737	3.393
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	5.690	4.793	6.195	5.336	6.195	5.440
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
Überdeckung in %	22,0%	49,7%	30,8%	61%	30,8%	60%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
bis zu sechs Monate	381	65	385	191
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	380	5	371	231
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	91	387	249	235
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	15	380	244	229
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	585	106	510	423
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	295	585	591	445
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	550	45	547	447
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.394	814	2.200	2.046
mehr als 10 Jahre	975	817	593	547

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	I 2018	I 2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	88,7%	85,7%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	95,9%	94,8%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

In der Deckung befinden sich keine Derivate.

* Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse gem. § 12 PfandBG

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2018	I 2017
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	4.076	3.641
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	534	441
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	509	391
mehr als 10 Mio. €	246	195

nach Nutzungsart (I)	I 2018	I 2017
wohnwirtschaftlich	4.222	3.727
gewerblich	1.144	941

nach Nutzungsart (II)	I 2018	I 2017
Land		
Bundesrepublik Deutschland		
Summe		

Kennzahlen	I 2018	I 2017
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG		
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	-	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG		
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,6	4,5
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG		
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,4%	55,6%

Anteil am Gesamtumlauf	I 2018	I 2017
Ordentliche Deckung (nominal)	5.365	4.668

Land	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien-häuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industrie-gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags-fähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	I 2018	1.249	2.476	496	74	5	-	1.065	-	-	5.365
	I 2017	1.077	2.225	425	185	-	-	756	-	-	4.668
Summe	I 2018	1.249	2.476	496	74	5	-	1.065	-	-	5.365
	I 2017	1.077	2.225	425	185	-	-	756	-	-	4.668

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	I 2018	I 2017
§19 (1) Nr.2 PfandBG	-	-
§19 (1) Nr.3 PfandBG	-	-

§ 28 (1) Nr. 4, 5 und 6 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 2 PfandBG				Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 3 PfandBG		Summe	
			Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	100	-	-	-	205	105	305	105
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	20	20	20
Summe	-	-	100	-	-	-	225	125	325	125

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag der leistungsgestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

