

Stichtag	Juni 2019
Referenz	Juli 2018

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert*	
	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	5.831	4.929	6.142	5.028	6.142	5.363
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	6.719	5.777	7.500	6.309	7.500	6.627
% 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 %	15,2%	17,2%	22,1%	25,5%	22,1%	23,6%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018
bis zu sechs Monate	5	112	309	295
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	21	410	328	349
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	100	5	314	244
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	545	15	276	256
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	596	610	691	519
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.143	270	773	614
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	212	593	622	617
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	3.000	1.381	2.634	2.244
mehr als 10 Jahre	210	1.534	772	638

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Juni 2019	Juli 2018
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	89,9%	88,9%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	88,6%	95,7%

§ 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	
	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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	Juni 2019	Juli 2018
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	4.838	4.236
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	693	582
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	669	519
mehr als 10 Mio. €	334	255

nach Nutzungsart (I)	Juni 2019	Juli 2018
wohnwirtschaftlich	5.084	4.403
gewerblich	1.450	1.189

nach Nutzungsart (II)	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		Juni 2019	1.558	2.970	556	11	27	-	1.412	-	-	6.534
		Juli 2018	1.299	2.592	512	68	5	-	1.116	-	-	5.592
Summe		Juni 2019	1.558	2.970	556	11	27	-	1.412	-	-	6.534
		Juli 2018	1.299	2.592	512	68	5	-	1.116	-	-	5.592

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	Juni 2019		Juli 2018	
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	-	0,0	-	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG	Jahre		Jahre	
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,6		4,6	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,5%		55,4%	

Anteil am Gesamtumlauf	Juni 2019		Juli 2018	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	6.534	112,1	5.592	113,5

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Jun 2019	Jul 2018
§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		Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018	
		Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018					
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	165	165	165	165
Niederlande	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	20	20	20
Summe	-	-	-	-	-	-	185	185	185	185

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	
	Juni 2019	Juli 2018	Juni 2019	Juli 2018
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-