

Stichtag	IV 2018
Referenz	IV 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*	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	5.125	3.674	5.250	3.749	5.250	3.883
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	6.218	5.315	6.737	5.825	6.737	5.968
% 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 %	21,3%	44,7%	28,3%	55,4%	28,3%	53,7%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
bis zu sechs Monate	415	324	359	263
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	5	112	267	323
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	15	410	304	254
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	70	5	290	222
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	560	85	627	496
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	545	560	648	535
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	623	45	613	529
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.836	1.269	2.425	2.137
mehr als 10 Jahre	1.057	865	685	555

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	IV 2018	IV 2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	89,4%	88,0%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	96,7%	96,1%

§ 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	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 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	IV 2018	IV 2017
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	4.453	3.921
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	608	501
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	567	495
mehr als 10 Mio. €	326	223

nach Nutzungsart (I)	IV 2018	IV 2017
wohnwirtschaftlich	4.648	4.050
gewerblich	1.305	1.090

Kennzahlen	IV 2018		IV 2017	
§ 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	55,3%		55,4%	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
Ordentliche Deckung (nominal)	5.953	116,2	5.140	139,9

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	IV 2018	1.413	2.707	527	11	8	-	1.286	-	-	5.953
	IV 2017	1.197	2.383	469	87	4	-	999	-	-	5.140
Summe	IV 2018	1.413	2.707	527	11	8	-	1.286	-	-	5.953
	IV 2017	1.197	2.383	469	87	4	-	999	-	-	5.140

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	IV 2018	IV 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	
	IV 2018	IV 2017	Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
			IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017				
Bundesrepublik Deutschland	-	-	50	50	-	-	165	105	215	155
Niederlande	-	-	30	-	-	-	-	-	30	-
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	20	20	20
Summe	-	-	80	50	-	-	185	125	265	175

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	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

V) Anhang des Jahresabschlusses

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsversteigerungs- und Zwangsverwaltungsverfahren	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten übernommenen	-	-	-	-
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen	-	-	-	-

