

Stichtag	II 2018
Referenz	II 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*	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	4.929	3.166	5.028	3.243	5.363	3.347
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	5.777	4.980	6.309	5.500	6.627	5.635
% 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 %	17,2%	57,3%	25,5%	69,6%	23,6%	68,4%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
bis zu sechs Monate	112	40	295	222
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	410	312	349	238
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	5	112	244	253
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	15	410	256	231
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	610	20	519	433
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	270	610	614	453
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	593	20	617	481
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.381	814	2.244	2.111
mehr als 10 Jahre	1.534	829	638	559

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2018	II 2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	88,9%	86,6%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	95,7%	94,7%

§ 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	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017	II 2018	II 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	II 2018	II 2017
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	4.236	3.755
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	582	469
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	519	423
mehr als 10 Mio. €	255	208

nach Nutzungsart (I)	II 2018	II 2017
wohnwirtschaftlich	4.403	3.855
gewerblich	1.189	1.000

nach Nutzungsart (II)	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	II 2018	1.299	2.592	512	68	5	-	1.116	-	-	5.592
	II 2017	1.121	2.295	439	189	0	-	811	-	-	4.855
Summe	II 2018	1.299	2.592	512	68	5	-	1.116	-	-	5.592
	II 2017	1.121	2.295	439	189	0	-	811	-	-	4.855

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	II 2018	II 2017
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG	in Mio. EUR	in %
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	-	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG	Jahre	Jahre
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,6	4,5
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %	in %
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,4%	58,4%

Anteil am Gesamtumlauf	II 2018	II 2017
Ordentliche Deckung (nominal)	5.592	4.855
	113,5	153,4

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	II 2018	II 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	
	II 2018	II 2017	Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	165	105	165	105
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	20	20	20
Summe	-	-	-	-	-	-	185	125	185	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	
	II 2018	II 2017	II 2018	II 2017
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

