

Stichtag	Sep. 2019
Referenz	Sep. 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*	
	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	5.826	4.880	6.397	4.934	6.976	4.934
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	6.866	6.055	7.746	6.556	8.157	6.556
% 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 %	17,9%	24,1%	21,1%	32,9%	16,9%	32,9%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018
bis zu sechs Monate	15	375	350	297
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	50	96	307	245
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	535	15	312	296
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	45	50	364	270
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.045	580	703	600
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	611	295	728	627
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	167	611	668	642
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.246	1.838	2.622	2.403
mehr als 10 Jahre	1.112	1.022	812	674

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Sep. 19	Sep. 18
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	89,9%	89,2%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	88,6%	96,6%

§ 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	
	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 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	Sep. 2019	Sep. 2018
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	4.970	4.424
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	715	605
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	690	549
mehr als 10 Mio. €	306	292

nach Nutzungsart (I)	Sep. 2019	Sep. 2018
wohnwirtschaftlich	5.238	4.612
gewerblich	1.443	1.257

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	Sep. 19	1.602	3.059	577	11	27	-	1.404	-	-	6.681
		Sep. 18	1.381	2.702	530	11	8	-	1.239	-	-	5.870
	<b>Summe</b>	<b>Sep. 19</b>	<b>1.602</b>	<b>3.059</b>	<b>577</b>	<b>11</b>	<b>27</b>	<b>-</b>	<b>1.404</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6.681</b>
		<b>Sep. 18</b>	<b>1.381</b>	<b>2.702</b>	<b>530</b>	<b>11</b>	<b>8</b>	<b>-</b>	<b>1.239</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5.870</b>

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	Sep. 2019	Sep. 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	4,7		4,6	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,4%		55,4%	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	6.681	114,7	5.870	120,3

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Sep. 2019	Sep. 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	
	Sep. 2019	Sep. 2018	Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	165	165	165	165
Niederlande	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	20	20	20
<b>Summe</b>	-	-	-	-	-	-	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>185</b>

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	
	Sep. 2019	Sep. 2018	Sep. 2019	Sep. 2018
keine	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-