

Stichtag	III 2018
Referenz	III 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*	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	4.880	3.673	4.934	3.735	4.934	3.887
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	6.055	5.149	6.556	5.670	6.556	5.804
% 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 %	24,1%	40,2%	32,9%	51,8%	32,9%	49,3%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
bis zu sechs Monate	375	5	297	253
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	96	369	245	257
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	15	380	296	246
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	50	91	270	231
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	580	65	600	474
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	295	580	627	486
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	611	45	642	490
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.838	769	2.403	2.154
mehr als 10 Jahre	1.022	1.371	674	558

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	III 2018	III 2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	89,2%	87,3%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	96,6%	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	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 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	III 2018	III 2017
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	4.424	3.866
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	605	495
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	549	463
mehr als 10 Mio. €	292	200

nach Nutzungsart (I)	III 2018	III 2017
wohnwirtschaftlich	4.612	3.979
gewerblich	1.257	1.046

Kennzahlen	III 2018		III 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	55,4%		58,2%	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
Ordentliche Deckung (nominal)	5.870	120,3	5.024	136,8

Land	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	III 2018	1.381	2.702	530	11	8	-	1.239	-	-	5.870
	III 2017	1.169	2.356	453	188	0	-	858	-	-	5.024
Summe	III 2018	1.381	2.702	530	11	8	-	1.239	-	-	5.870
	III 2017	1.169	2.356	453	188	0	-	858	-	-	5.024

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	III 2018	III 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		
	III 2018	III 2017	Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	
			III 2018	III 2017	III 2018	III 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	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

