

Stichtag	I 2018
Referenz	I 2017

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	270,00	290,00	296,94	323,20	262,54	284,31	339,72	332,80
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	709,23	625,94	784,32	708,51	682,97	615,56	910,95	729,55
davon gattungsklassische Deckungswerte	674,23	590,94	748,92	672,81	652,48	585,53	869,59	692,53
davon weitere Deckungswerte	35,00	35,00	35,40	35,70	30,49	30,04	41,36	37,01
Überdeckung in %	162,68%	115,84%	164,14%	119,22%	160,14%	116,51%	168,15%	119,21%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,07%					

II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2018		Laufzeitstruktur I 2017		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2018	I 2017
bis zu sechs Monate	21,07	25,00	17,15	30,00	-3,93	-12,85
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	16,42	5,00	13,86	0,00	11,42	13,86
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	18,82	5,00	13,75	25,00	13,82	-11,25
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	32,27	10,00	16,00	5,00	22,27	11,00
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	70,70	30,00	52,13	15,00	40,70	37,13
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	63,39	60,00	69,51	30,00	3,39	39,51
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	65,40	30,00	61,81	60,00	35,40	1,81
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	321,94	55,00	299,73	65,00	266,94	234,73
über 10 Jahre	99,21	50,00	82,00	60,00	49,21	22,00

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statistischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung nach	I 2018				I 2017				gesetzl. Grenze
	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		§19 Abs.1 Nr 3 PfandBG 20%- Grenze		Summe	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	35,00	35,00	35,00	35,00
Summe	-	-	-	-	35,00	35,00	35,00	35,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
keine	-	-	-	-	-	-

	I 2018	I 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,20%	99,24%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	98,15%	98,28%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,32%	54,24%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sicher gestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,31	4,36

Stichtag	I 2018
Referenz	I 2017

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2018	I 2017	Anteil am Gesamtbeitrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	I 2018	I 2017	Anteil am Gesamtbeitrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	611,85	537,46		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	35,00	12,96%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	43,83	36,87		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	18,54	16,61		davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%
mehr als 10 Mio.€	-	-		Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	15,00	15,00	5,56%
wohnwirtschaftlich	636,43	555,99		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	20,00	20,00	7,41%
gewerblich	37,80	34,94		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	709,23	625,94	262,68%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	91,40	83,18	12,89%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	451,46	390,46	63,65%				
Mehrfamilienhäuser	93,57	82,35	13,19%				
Bürogebäude	6,40	6,11	0,90%				
Handelsgebäude	1,75	2,08	0,25%				
Industriegebäude	21,15	20,13	2,98%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	8,51	6,62	1,20%				
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%				
Bauplätze	-	-	0,00%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 2 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	I 2018	I 2017	I 2018	I 2017
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00