



Stichtag: 30.09.2018

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)	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	185,10	190,10	205,95	216,35	188,56	194,20	225,66	219,05
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	591,01	614,62	652,27	690,95	575,57	606,05	746,39	712,75
davon gattungsklassische Deckungswerte	576,01	599,62	637,17	675,82	560,67	591,25	730,19	697,69
davon weitere Deckungswerte	15,00	15,00	15,10	15,13	14,90	14,80	16,20	15,06
Überdeckung in %	219,29%	223,31%	216,70%	219,37%	205,24%	212,07%	230,76%	225,38%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,33%	6,99%				

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2018		Laufzeitstruktur III 2017		Überhang	
	Deckungs-masse	Pfandbrief-umlauf	Deckungs-masse	Pfandbrief-umlauf	III 2018	III 2017
bis zu 6 Monate	24,25	0,00	23,78	0,00	24,25	23,78
mehr als 6 Monate bis zu zwölf Monaten	17,78	0,00	22,35	5,00	17,78	17,35
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	19,87	0,00	16,29	0,00	19,87	16,29
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	32,48	20,00	18,63	0,00	12,48	18,63
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	53,40	40,10	55,27	20,00	13,30	35,27
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	60,17	65,00	58,82	40,10	-4,83	18,72
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	61,81	20,00	60,69	65,00	41,81	-4,31
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	263,60	35,00	298,33	55,00	228,60	243,33
über 10 Jahre	57,65	5,00	60,45	5,00	52,65	55,45

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statisches Verfahren gem. PfandBarwertV

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

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung nach	III 2018				III 2017				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	0,00			0,00	0,00			0,00	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	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	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	15,00	15,00	15,00	15,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	15,00	15,00	15,00	15,00

Nettoarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettoarwert in Fremdwährung	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	III 2018	III 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,75%	96,65%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	53,67%	53,94%
Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	0,00	0,00
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	5,69	5,46

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse							(Angaben in Mio. Euro)		
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	III 2018	III 2017	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2018	III 2017	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumschlages		
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte					
bis einschließlich 300 T€	432,90	440,74	73,25%	weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	15,00	15,00	8,10%		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	78,19	85,73	13,23%	davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%		
mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio.€	64,91	73,14	10,98%	davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	0,00	0,00%		
mehr als 10 Mio.€	0,00	0,00	0,00%	Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%		
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)					
wohnwirtschaftlich	517,68	531,22	87,59%	Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	15,00	15,00	8,10%		
gewerblich	58,33	68,39	9,87%		0,00	0,00	0,00%		
				Summe gattungsklassische und weitere Deckung					
				591,01 614,62 319,29%					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland									
Eigentumswohnungen	91,64	92,96	15,51%						
Ein- und Zweifamilienhäuser	301,54	307,34	51,02%						
Mehrfamilienhäuser	124,49	130,93	21,06%						
Bürogebäude	17,20	17,61	2,91%						
Handelsgebäude	2,16	2,22	0,37%						
Industriegebäude	19,85	19,98	3,36%						
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	19,12	28,58	3,23%						
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%						
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%						

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 2 Pfandbriefgesetz					(Angaben in Mio. Euro)	
Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag		III 2018	III 2017
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017		
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00		
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00		