

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	377,20	377,20	395,73	400,62	371,89	370,53	430,40	404,87
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.328,86	1.220,98	1.465,16	1.363,63	1.282,46	1.193,65	1.693,38	1.414,26
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.312,66	1.193,58	1.447,56	1.335,96	1.266,00	1.167,11	1.674,10	1.386,49
davon sonstige Deckungswerte	16,20	27,40	17,60	27,67	16,46	26,54	19,28	27,76
Überdeckung in %	252,30%	223,70%	270,24%	240,38%	244,85%	222,15%	293,45%	249,31%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			4,45%					

*Der Risikobarwert wird nach statischem Verfahren gem. Pfandbrief-Barwertverordnung ermittelt (Zinskurve + / - 250 BP).

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2018			III 2017		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	108,54	5,00	103,54	96,35	-	96,35
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	48,98	25,00	23,98	34,32	-	34,32
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	31,15	20,00	11,15	43,77	5,00	38,77
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	50,83	-	50,83	49,63	25,00	24,63
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	110,27	150,90	- 40,63	86,42	20,00	66,42
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	105,35	85,00	20,35	113,85	150,90	- 37,05
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	120,76	60,00	60,76	104,07	85,00	19,07
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	568,19	25,00	543,19	535,83	65,00	470,83
über 10 Jahre	184,79	6,30	178,49	156,75	26,30	130,45

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2018	III 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	94,25%	92,77%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	68,19%	68,19%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,67%	54,63%
Volumengew. Ø der seit Kreditvergabe verstrichenen Lfz.	4,99	5,18
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen das Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)*	-	-

*Zum Stichtag / Referenzstichtag befanden sich keine ausländischen Grundstücksicherheiten in Deckung.

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

Weitere Deckung nach § 19 Abs. 1 Nr. 1-3	III 2018				III 2017			
	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	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach Art der gesetzlichen Begrenzung	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen*		§19 Abs.1 Nr 3 PfandBG 20%-Grenze		Gesamt	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	9,20	23,90	9,20	23,90
Rumänien	-	-	-	-	7,00	-	7,00	-
Spanien	-	-	-	-	-	3,50	-	3,50
Gesamt	-	-	-	-	16,20	27,40	16,20	27,40

* i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013

** In der Tabelle "Weitere Deckung nach § 19 Abs. 1 Nr. 1-3" werden nur Deckungswerte ausgewiesen, die auf die gesetzlichen Grenzwerte der weiteren Deckung anzurechnen sind. In der Tabelle "Weitere Deckung nach Art der gesetzlichen Begrenzung" erfolgt der Ausweis inklusive der Deckungswerte, die zum Zwecke der sichernden Überdeckung und zur Liquiditätssicherung gehalten werden. Diese sind nicht auf die gesetzlichen Grenzen anzurechnen.

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

(Angaben in Mio. Euro)

Nach Größenklassen	III 2018	III 2017
bis einschließlich 300 T€	572,98	549,54
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	249,68	217,57
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	490,00	426,47
mehr als 10 Mio.€	-	-

Nach Nutzungsart (I) in Deutschland	III 2018	III 2017
wohnwirtschaftlich	828,01	759,75
gewerblich	484,66	433,83

Nach Nutzungsart (II) in Deutschland	III 2018	Anteil an der Deckungsmasse	III 2017	Anteil an der Deckungsmasse
Eigentumswohnungen	90,02	6,77%	84,90	6,95%
Ein- und Zweifamilienhäuser	434,29	32,68%	417,09	34,16%
Mehrfamilienhäuser	303,70	22,85%	257,77	21,11%
Bürogebäude	77,72	5,85%	80,70	6,61%
Handelsgebäude	55,15	4,15%	48,54	3,98%
Industriegebäude	168,85	12,71%	57,96	4,75%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	179,62	13,52%	243,67	19,96%
unfertige / nicht ertragsfähige Neubauten	-	0,00%	-	0,00%
Bauplätze	3,32	0,24%	2,96	0,24%

Weitere Deckungswerte	III 2018	Anteil am Pfandbriefumlauf	III 2017	Anteil am Pfandbriefumlauf
Gesamt	16,20	4,29%	27,40	7,26%
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-	-	-
davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	-	-
davon höchste Geldforderung gegen KI	-	-	-	-
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	-	-
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	16,20	4,29%	27,40	7,26%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1 a PfandBG	-	0,00%	-	0,00%
Summe gattungsklassische und sonstige Deckungswerte	1.328,86	352,30%	1.220,98	323,70%

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

V) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 2 zu rückständigen Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2018	III 2017
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen	-	-
Forderungen mit mindestens 5 % Rückstandsbetrag	-	-