

Stichtag	30.09.2018
Referenz	30.09.2017

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	223,66	220,35	234,21	234,90	266,30	209,61
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	234,11	233,28	253,88	253,03	285,67	226,30
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	4,67%	5,87%	8,40%	7,72%	7,27%	7,96%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017
bis zu sechs Monate	8,59	16,49	16,74	11,66
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	14,38	15,77	11,68	20,99
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	8,43	7,83	13,68	10,49
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	7,92	13,58	15,15	10,85
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	27,51	17,27	23,08	26,13
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	31,84	26,18	36,58	21,02
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	13,07	27,98	22,95	34,03
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	106,92	84,25	85,75	86,37
über 10 Jahre	5,00	11,00	8,49	11,75

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.09.2018	30.09.2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	99,11%	98,89%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

§ 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	
	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	30.09.2018	30.09.2017
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	91,74	103,41
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	75,57	70,63
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	60,96	53,77
mehr als 10 Mio. €	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)		
wohnwirtschaftlich	96,74	113,13
gewerblich	131,52	114,68

nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)

Staat	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	30.09.2018	14,33	47,83	34,59	1,20	0,53	0,00	129,79	0,00	0,00	228,26
	30.09.2017	10,71	64,41	38,01	3,62	4,37	0,30	106,39	0,00	0,00	227,81
Summe	30.09.2018	14,33	47,83	34,59	1,20	0,53	0,00	129,79	0,00	0,00	228,26
	30.09.2017	10,71	64,41	38,01	3,62	4,37	0,30	106,39	0,00	0,00	227,81

Weitere Kennzahlen		30.09.2018	30.09.2017
§28 (1) Nr. 7 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) PfandBG überschreiten.	in Mio. EUR	0,00	0,00%
§28 (1) Nr. 11 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning).	in Jahren	5,88	6,06
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	41,85%	33,36%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	228,26	227,81
16493000	in %	102,06%	103,4%

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG		
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	30.09.18	30.09.17
§19 (1) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00
§19 (1) Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00

§ 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	
			Gesamt		davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		30.09.18	30.09.17		
			30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17				
Staat										
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	4,35	3,95	0,00	0,00	1,50	1,52	5,85	5,47
Summe	0,00	0,00	4,35	3,95	0,00	0,00	1,50	1,52	5,85	5,47

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	30.09.2018	30.09.2017	30.09.2018	30.09.2017
Staat				
keine	0,00	0,01	0,00	0,00
Summe	0,00	0,01	0,00	0,00

Stichtag	30.09.18
Referenz	30.09.17

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	0,33	2,78	0,33	2,85	0,33	2,83
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	2,08	3,70	2,36	4,00	2,21	3,79
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	536,63%	33,14%	605,07%	40,34%	566,67%	33,84%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17
bis zu sechs Monate	0,23	2,09	0,32	1,06
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,10	0,37	0,14	0,60
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	0,23	0,11	0,27
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,00	0,10	0,11	0,14
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	0,00	0,22	0,23
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,00	0,00	0,30	0,22
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	0,00	0,89	0,30
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,00	0,00	0,00	0,89
über 10 Jahre	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.09.2018	30.09.2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	100,00%	97,30%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

§ 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	
	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17	30.09.18	30.09.17
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs (nominal)	30.09.18		30.09.17	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Gesamte Deckungsmasse	2,08	636,63%	3,70	133,14%
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	2,03	620,42%	3,60	129,55%
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	0,05	16,21%	0,10	3,59%
davon Sichernde Überdeckung nach § 20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,05	16,21%	0,10	3,59%

§28 (3) Nr.1 PfandBG Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen nach Größenklassen	30.09.18	30.09.17
bis zu 10 Millionen €	2,03	3,60
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	0,00	0,00
mehr als 100 Millionen €	0,00	0,00

§28 (3) Nr. 2 Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen	Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		GESAMT	darin enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung
		geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von		
Land	30.09.2018	0,00	0,00	2,03	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,03	0,00
	30.09.2017	0,00	0,00	3,00	0,00	0,00	0,00	0,60	0,00	3,60	0,00
DECKUNGS-WERTE, GESAMT	30.09.2018	0,00	0,00	2,03	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,03	0,00
	30.09.2017	0,00	0,00	3,00	0,00	0,00	0,00	0,60	0,00	3,60	0,00

