

Stichtag	Q4 2018
Referenz	Q4 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 *	
	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	1.332,40	1.128,70	1.336,08	1.121,51	1.387,05	1.141,97
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1.546,01	1.453,22	1.632,11	1.540,43	1.659,97	1.544,11
% 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 %	16,03%	28,75%	22,16%	37,35%	19,68%	35,21%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017
bis zu sechs Monate	129,90	25,20	56,38	25,20
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	105,00	33,00	114,08	20,20
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	37,50	133,00	70,21	55,89
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	40,00	105,00	121,82	138,93
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	164,00	77,50	110,90	225,50
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	300,00	164,00	289,25	136,09
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	265,00	300,00	314,78	209,30
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	291,00	291,00	468,60	642,12
über 10 Jahre	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Q4 2018	Q4 2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	31,69%	25,43%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	81,39%	77,76%

§ 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	
	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017
EUR	1.659,97	1.544,11	1.387,05	1.141,97	1,00	1,00	272,92	402,14	272,92	402,14

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

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	Q4 2018	Q4 2017
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	0,00	0,00
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	0,00	0,00
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	119,64	68,46
mehr als 10 Mio. €	1.280,87	1.254,26

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Q4 2018	Q4 2017
wohnwirtschaftlich	82,59	0,00
gewerblich	1.317,92	1.322,72

Weitere Kennzahlen	Q4 2018	Q4 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	2,88	2,15
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	58,10%	57,92%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	1.400,51	1.322,72
Anteil am Gesamtumlauf	in %	105,11%	117,19%

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

Staat	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags-fähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	Q4 2018	0,00	0,00	82,59	217,36	68,60	0,00	31,89	0,00	0,00	400,44
	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	297,61	74,97	0,00	55,29	0,00	0,00	427,86
Frankreich inkl. Monaco	Q4 2018	0,00	0,00	0,00	487,47	374,71	0,00	35,81	0,00	0,00	897,99
	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	432,29	372,23	0,00	35,81	0,00	0,00	840,32
Italien	Q4 2018	0,00	0,00	0,00	12,24	47,17	0,00	0,00	0,00	0,00	59,42
	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	20,17	34,36	0,00	0,00	0,00	0,00	54,54
Portugal inkl. Azoren und Madeira	Q4 2018	0,00	0,00	0,00	0,00	24,57	0,00	0,00	0,00	0,00	24,57
	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Spanien	Q4 2018	0,00	0,00	0,00	0,00	18,09	0,00	0,00	0,00	0,00	18,09
	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	Q4 2018	0,00	0,00	82,59	717,07	533,15	0,00	67,70	0,00	0,00	1.400,51
	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	750,07	481,56	0,00	91,10	0,00	0,00	1.322,72

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG		
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	Q4 2018	Q4 2017
§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					
	Staat	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	145,50	130,50	145,50	130,50
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	145,50	130,50	145,50	130,50

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	
	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00

V) Anhang des Jahresabschlusses

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsversteigerungsverfahren	0,00	0,00	0,00	0,00
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsverwaltungsverfahren	0,00	0,00	0,00	0,00
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsverwaltungs- verfahren mit gleichzeitigen Zwangsversteigerungsverfahren	0,00	0,00	0,00	0,00
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	0,00	0,00	0,00	0,00
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten übernommenen Grundstücke	0,00	0,00	0,00	0,00
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen (Angaben in Mio. Euro)	0,00	0,00	0,00	0,00