

Stichtag	Q3 2017
Referenz	Q3 2016

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 *	
	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	1.145,70	947,70	1.138,37	960,46	1.159,74	964,91
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1.439,24	1.112,94	1.530,38	1.185,45	1.533,67	1.182,51
% 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 %	25,62%	17,44%	34,44%	23,43%	32,24%	22,55%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016
bis zu sechs Monate	42,20	0,00	0,20	36,18
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,00	52,00	25,20	12,11
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	33,00	42,20	20,20	63,81
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	138,00	0,00	155,09	25,11
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	137,50	171,00	162,11	249,95
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	204,00	137,50	170,92	142,42
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	290,00	204,00	214,66	155,24
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	301,00	341,00	615,87	428,11
über 10 Jahre	0,00	0,00	75,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Q3 2017	Q3 2016
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	24,43%	22,51%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	78,09%	69,51%

§ 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	
	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016
EUR	1.533,67	1.182,51	1.159,74	964,91	1,00	1,00	373,93	217,60	373,93	217,60

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

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	Q3 2017	Q3 2016
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. €	63,19	14,41
mehr als 10 Mio. €	1.245,54	980,53

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Q3 2017	Q3 2016
wohnwirtschaftlich	0,00	0,00
gewerblich	1.308,74	994,94

Weitere Kennzahlen		Q3 2017	Q3 2016
§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	1,94	1,64
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	57,98%	59,60%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	1.308,74	994,94
Anteil am Gesamtumlauf	in %	114,23%	104,99%

nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	Q3 2017	0,00	0,00	0,00	279,30	80,39	0,00	55,29	0,00	0,00	414,98
	Q3 2016	0,00	0,00	0,00	255,65	96,17	0,00	71,11	0,00	0,00	422,92
Frankreich inkl. Monaco	Q3 2017	0,00	0,00	0,00	433,16	366,96	0,00	35,81	0,00	0,00	835,93
	Q3 2016	0,00	0,00	0,00	340,14	212,37	0,00	19,52	0,00	0,00	572,03
Italien	Q3 2017	0,00	0,00	0,00	23,46	34,36	0,00	0,00	0,00	0,00	57,82
	Q3 2016	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	Q3 2017	0,00	0,00	0,00	735,92	481,72	0,00	91,10	0,00	0,00	1.308,74
	Q3 2016	0,00	0,00	0,00	595,78	308,53	0,00	90,63	0,00	0,00	994,94

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	Q3 2017	Q3 2016
§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					
			Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016		
Staat										
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	130,50	118,00	130,50	118,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	130,50	118,00	130,50	118,00

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00