

Stichtag	Q4 2017
Referenz	Q4 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 *	
	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	1.128,70	947,70	1.121,51	947,33	1.141,97	964,14
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1.453,22	1.339,42	1.540,43	1.428,75	1.544,11	1.429,12
% 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 %	28,75%	41,33%	37,35%	50,82%	35,21%	48,23%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016
bis zu sechs Monate	25,20	17,00	25,20	45,18
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	33,00	52,00	20,20	37,84
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	133,00	25,20	55,89	25,11
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	105,00	33,00	138,93	20,11
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	77,50	238,00	225,50	228,46
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	164,00	77,50	136,09	214,82
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	300,00	164,00	209,30	84,06
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	291,00	341,00	642,12	578,84
über 10 Jahre	0,00	0,00	0,00	105,00

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Q4 2017	Q4 2016
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	25,43%	18,67%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	77,76%	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	
	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016
EUR	1.544,11	1.429,12	1.141,97	964,14	1,00	1,00	402,14	464,98	402,14	464,98

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

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	Q4 2017	Q4 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. €	68,46	45,34
mehr als 10 Mio. €	1.254,26	1.169,09

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Q4 2017	Q4 2016
wohnwirtschaftlich	0,00	0,00
gewerblich	1.322,72	1.214,42

Weitere Kennzahlen		Q4 2017	Q4 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	2,15	1,55
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	57,92%	57,26%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	1.322,72	1.214,42
Anteil am Gesamtumlauf	in %	117,19%	128,14%

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
Staat	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	297,61	74,97	0,00	55,29	0,00	0,00	427,86
	Q4 2016	0,00	0,00	0,00	247,84	96,17	0,00	104,20	0,00	0,00	448,20
Frankreich inkl. Monaco	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	432,29	372,23	0,00	35,81	0,00	0,00	840,32
	Q4 2016	0,00	0,00	0,00	401,46	338,21	0,00	26,55	0,00	0,00	766,22
Italien	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	20,17	34,36	0,00	0,00	0,00	0,00	54,54
	Q4 2016	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	Q4 2017	0,00	0,00	0,00	750,07	481,56	0,00	91,10	0,00	0,00	1.322,72
	Q4 2016	0,00	0,00	0,00	649,30	434,37	0,00	130,75	0,00	0,00	1.214,42

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	Q4 2017	Q4 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					
			Staat	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	130,50	125,00	130,50	125,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	130,50	125,00	130,50	125,00

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	
	Q4 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016
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 2017	Q4 2016	Q4 2017	Q4 2016
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