

Stichtag	Q2 2018
Referenz	Q2 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 *	
	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	1.368,50	1.180,70	1.367,27	1.171,70	1.367,27	1.195,69
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1.582,90	1.387,13	1.677,77	1.476,41	1.677,77	1.480,18
% 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 %	15,67%	17,48%	22,71%	26,01%	22,71%	23,79%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017
bis zu sechs Monate	33,00	52,00	20,52	0,11
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	133,00	25,20	56,22	25,11
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	105,00	33,00	113,74	20,11
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	37,50	133,00	70,14	55,81
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	104,00	142,50	206,52	213,88
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	390,00	104,00	164,63	195,33
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	270,00	390,00	290,67	132,03
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	296,00	301,00	660,46	664,75
über 10 Jahre	0,00	0,00	0,00	80,00

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Q2 2018	Q2 2017
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	31,71%	24,02%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	81,66%	75,78%

§ 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	
	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017
EUR	1.677,77	1.480,18	1.367,27	1.195,69	1,00	1,00	310,50	284,49	310,50	284,49

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

## II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	Q2 2018	Q2 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. €	107,40	49,61
mehr als 10 Mio. €	1.355,01	1.207,02

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Q2 2018	Q2 2017
wohnwirtschaftlich	65,01	0,00
gewerblich	1.397,39	1.256,63

Weitere Kennzahlen		Q2 2018	Q2 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	2,43	1,74
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	58,09%	57,79%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	1.462,40	1.256,63
Anteil am Gesamtumlauf	in %	106,86%	106,43%

### 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	Q2 2018	0,00	0,00	65,01	301,57	60,50	0,00	55,29	0,00	0,00	482,36
	Q2 2017	0,00	0,00	0,00	260,83	81,08	0,00	55,75	0,00	0,00	397,66
Frankreich inkl. Monaco	Q2 2018	0,00	0,00	0,00	479,12	355,10	0,00	35,81	0,00	0,00	870,03
	Q2 2017	0,00	0,00	0,00	433,22	342,72	0,00	48,67	0,00	0,00	824,61
Italien	Q2 2018	0,00	0,00	0,00	20,17	47,17	0,00	0,00	0,00	0,00	67,35
	Q2 2017	0,00	0,00	0,00	0,00	34,36	0,00	0,00	0,00	0,00	34,36
Portugal inkl. Azoren und Madeira	Q2 2018	0,00	0,00	0,00	0,00	24,57	0,00	0,00	0,00	0,00	24,57
	Q2 2017	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Spanien	Q2 2018	0,00	0,00	0,00	0,00	18,09	0,00	0,00	0,00	0,00	18,09
	Q2 2017	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Summe</b>	Q2 2018	0,00	0,00	65,01	800,86	505,43	0,00	91,10	0,00	0,00	1.462,40
	Q2 2017	0,00	0,00	0,00	694,04	458,16	0,00	104,42	0,00	0,00	1.256,63

### III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	Q2 2018	Q2 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							
		Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017
Staat											
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	120,50	130,50	120,50	130,50	
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>120,50</b>	<b>130,50</b>	<b>120,50</b>	<b>130,50</b>	

### 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	
	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>