

Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 30.06.2018

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

PfandBG § 28 (1) Nr. 1 und 3

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert ¹⁾	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
Hypothekendarlehen	5.732,2	5.410,0	6.312,6	6.029,7	5.983,9	5.606,4
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	7.313,3	7.156,8	8.028,5	7.943,7	7.622,4	7.429,8
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	1.581,1	1.746,8	1.715,9	1.914,0	1.638,5	1.823,4
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-

¹⁾ Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. PfandBarwertV verwendet.

PfandBG § 28 (1) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	Laufzeitenstruktur des Hypothekendarlehens		Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse		davon weitere Deckungswerte	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
<= 0,5 Jahre	161,2	165,0	279,7	314,4	-,-	-,-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	230,0	88,0	353,3	277,5	-,-	-,-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	223,5	244,2	346,9	300,4	-,-	-,-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	419,9	230,0	320,6	407,5	-,-	-,-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	315,6	637,5	749,7	696,6	-,-	-,-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	649,7	332,7	737,2	696,7	-,-	-,-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	883,1	649,7	632,8	673,9	-,-	-,-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.154,8	2.253,1	2.979,4	2.801,3	200,0	200,0
> 10 Jahre	694,5	810,0	913,9	988,6	-,-	-,-

PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	30.06.2018	30.06.2017
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	97,3	97,2
Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	99,1	99,1

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

PfandBG § 28 (2) Nr. 1

Angaben in Mio. EUR

a) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Größenklassen	30.06.2018	30.06.2017
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	2.913,3	3.075,3
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.353,1	1.235,7
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.297,5	2.131,4
Mehr als 10 Mio. EUR	549,4	514,5

b) und c) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Nutzungsart und nach Staaten²⁾

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
Eigentumswohnungen	778,3	793,0	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	2.100,9	2.165,9	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.311,1	2.144,4	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	890,1	784,1
Handelsgebäude	-,-	-,-	429,1	317,3
Industriegebäude	-,-	-,-	52,9	25,2
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	551,0	727,0
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

²⁾ keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	30.06.2018	30.06.2017
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) überschreiten (in Mio. EUR)	0,0	0,0
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (in Jahren)	6,3	6,2

PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	30.06.2018	30.06.2017
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)	51,6	52,0

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2018	30.06.2017
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 2 übersteigen	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 3 übersteigen	0,0	0,0

PfandBG § 28 (1) Nr. 4, 5 und 6

	30.06.2018	30.06.2017
Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2	0,0	0,0
<i>davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d.Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013</i>	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 3	200,0	200,0

IV) Übersicht der rückständigen Leistungen

PfandBG § 28 (2) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2018	30.06.2017
Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen	0,0	0,0
Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	0,0	0,0