

Stichtag	IV 2014
Referenz	IV 2013

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert*	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	1.246,90	1.143,90	1.392,32	1.260,83	1.344,11	1.313,93
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	3.455,24	3.191,65	3.917,79	3.466,12	3.742,93	3.630,12
% 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 %	177,11%	179,01%	181,39%	174,91%	178,47%	176,28%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist bis zu sechs Monate	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	IV 2014	IV 2013**	IV 2014	IV 2013**
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	10,00	107,00	197,92	352,79
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	0,00	151,40	0,00
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	38,00	183,50	172,12	443,11
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	95,00	38,00	308,40	283,82
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	125,80	70,00	389,64	274,57
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	414,60	125,80	346,26	290,24
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	382,00	619,60	1.440,75	1.275,45
mehr als 10 Jahre	8,00	0,00	268,20	271,68

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	IV 2014	IV 2013
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	68,61	n.b.
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	86,61	n.b.

§ 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	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

In der Deckung befinden sich keine Derivate.

\* Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

\*\* Geringerer Detaillierungsgrad in 2013, aggregierte Werte.

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse gem. § 12 PfandBG

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	IV 2014	IV 2013
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	2.791,16	2.583,49
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	287,71	0,00
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	159,87	392,16**
mehr als 10 Mio. €	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I)	IV 2014	IV 2013
wohnwirtschaftlich	2.808,22	2.615,64
gewerblich	430,53	360,01

nach Nutzungsart (II)	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser*	Mehrfamilienhäuser*	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht entragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	IV 2014	762,21	1.696,08	349,92	0,00	0,00	0,00	430,53	0,00	0,00	3.238,74
	IV 2013	691,39	1.520,60	403,65	0,00	0,00	0,00	360,01	0,00	0,00	2.975,65
<b>Summe</b>	<b>IV 2014</b>	<b>762,21</b>	<b>1.696,08</b>	<b>349,92</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>430,53</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.238,74</b>
	<b>IV 2013</b>	<b>691,39</b>	<b>1.520,60</b>	<b>403,65</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>360,01</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.975,65</b>

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

\* In 2013 waren Zweifamilienhäuser den Mehrfamilienhäusern zugeordnet.

\*\* In 2013 aggregierter Wert mehr als 300 Tsd. € bis zu 10 Mio. €

Kennzahlen	IV 2014	IV 2013
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG		
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	0,00	0,00
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG		
Seasoning	4,95	n.b.
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG		
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	48,77	n.b.

Anteil am Gesamtumlauf	IV 2014	IV 2013
Ordentliche Deckung (nominal)	3.238,74	2.975,65

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	IV 2014	IV 2013
§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	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	94,50	0,00	0,00	140,00	45,00	140,00	139,50
Europäische Institutionen	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	76,50	76,50	76,50	76,50
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>94,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>216,50</b>	<b>121,50</b>	<b>216,50</b>	<b>216,00</b>

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag der leistungsgestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
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>

V) Anhang des Jahresabschlusses

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsversteigerungs- und Zwangsverwaltungsverfahren	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	0,00	0,00	0,00	0,00