

Stichtag	IV 2017
Referenz	IV 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*	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	3.674	3.190	3.749	3.341	3.883	3.390
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	5.315	4.522	5.825	5.087	5.968	5.151
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
Überdeckung in %	44,7%	41,7%	55,4%	52,3%	53,7%	52,0%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
bis zu sechs Monate	324	55	263	190
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	112	40	323	207
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	410	324	254	218
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	5	119	222	236
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	85	415	496	406
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	560	85	535	430
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	45	566	529	429
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.269	806	2.137	1.911
mehr als 10 Jahre	865	782	555	496

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	IV 2017	IV 2016
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	88,0%	84,3%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	96,1%	94,0%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Netto-Barwert in Fremdwährung		Netto-Barwert in EUR	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

In der Deckung befinden sich keine Derivate.

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

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse gem. § 12 PfandBG

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	IV 2017	IV 2016
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	3.921	3.514
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	501	429
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	495	336
mehr als 10 Mio. €	223	126

nach Nutzungsart (I)	IV 2017	IV 2016
wohnwirtschaftlich	4.050	3.594
gewerblich	1.090	810

Kennzahlen	IV 2017	IV 2016
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG		
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	in Mio. EUR: -	in Mio. EUR: -
	in %: 0,0	in %: 0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG		
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	Jahre: 4,6	Jahre: 4,6
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG		
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	in %: 55,4	in %: 55,6

Anteil am Gesamtumlauf	IV 2017	IV 2016
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR: 5.140	in Mio. EUR: 4.405
	in %: 139,9	in %: 138,1

nach Nutzungsart (II)	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Land	IV 2017	1.197	2.383	469	87	4	-	999	-	-	5.140
	IV 2016	1.032	2.164	399	184	-	-	626	-	-	4.405
Summe	IV 2017	1.197	2.383	469	87	4	-	999	-	-	5.140
	IV 2016	1.032	2.164	399	184	-	-	626	-	-	4.405

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	IV 2017	IV 2016
§19 (1) Nr.2 PfandBG	-	-
§19 (1) Nr.3 PfandBG	-	-

§ 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 Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	50	-	-	-	105	99	155	99
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	19	20	19
Summe	-	-	50	-	-	-	125	118	175	118

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 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

V) Anhang des Jahresabschlusses

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
Anzahl der am Abschlussstag 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