

Stichtag	III 2017
Referenz	III 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*	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	3.673	2.904	3.735	3.089	3.887	3.070
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	5.149	4.209	5.670	4.818	5.804	4.802
% 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 %	40,2%	44,9%	51,8%	56,0%	49,3%	56,4%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
bis zu sechs Monate	5	73	253	207
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	369	65	257	171
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	380	5	246	204
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	91	387	231	209
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	65	470	474	379
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	580	101	486	379
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	45	590	490	403
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	769	1.031	2.154	1.800
mehr als 10 Jahre	1.371	183	558	457

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	III 2017	III 2016
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	87,3%	83,1%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	96,1%	93,4%

§ 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	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 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	III 2017	III 2016
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	3.866	3.311
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	495	371
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	463	307
mehr als 10 Mio. €	200	126

nach Nutzungsart (I)	III 2017	III 2016
wohnwirtschaftlich	3.979	3.361
gewerblich	1.046	754

nach Nutzungsart (II)

Land	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industrie-gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	III 2017	1.169	2.356	453	188	0	-	858	-	-	5.024
	III 2016	971	2.038	352	178	-	-	576	-	-	4.115
<b>Summe</b>	III 2017	<b>1.169</b>	<b>2.356</b>	<b>453</b>	<b>188</b>	<b>0</b>	<b>-</b>	<b>858</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5.024</b>
	III 2016	<b>971</b>	<b>2.038</b>	<b>352</b>	<b>178</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>576</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4.115</b>

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	III 2017		III 2016	
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	-	0,0	-	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG	Jahre		Jahre	
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,6		4,6	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	58,2		55,6	
Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	5.024	136,8	4.115	141,7

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	III 2017	III 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 Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	105	75	105	75
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	19	20	19
<b>Summe</b>	-	-	-	-	-	-	<b>125</b>	<b>94</b>	<b>125</b>	<b>94</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	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
keine	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-