

Stichtag	III 2016
Referenz	III 2015

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 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	2.904	1.142	3.089	1.259	3.070	1.213
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	4.209	3.611	4.818	4.061	4.802	3.877
% 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 %	44,9%	216,2%	56,0%	222,6%	56,4%	219,5%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
bis zu sechs Monate	73	10	207	187
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	65	0	171	152
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	5	63	204	183
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	387	65	209	150
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	470	75	379	401
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	101	470	379	397
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	590	65	403	358
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.031	376	1.800	1.443
mehr als 10 Jahre	183	18	457	339

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	III 2016	III 2015
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	83,1%	76,8%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	93,4%	83,2%

§ 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 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 2016	III 2015

nach Größenklassen	III 2016	III 2015
bis zu 300 Tsd. €	3.311	2.968
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	371	304
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	307	172
mehr als 10 Mio. €	126	0

nach Nutzungsart (I)	III 2016	III 2015
wohnwirtschaftlich	3.361	2.969
gewerblich	754	475

nach Nutzungsart (II)	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handels-gebäude	Industrie- gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags-fähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	III 2016	971	2.038	352	178	0	0	576	0	0	4.115
	III 2015	816	1.871	282	34	0	0	441	0	0	3.444
<b>Summe</b>	<b>III 2016</b>	<b>971</b>	<b>2.038</b>	<b>352</b>	<b>178</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>576</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>4.115</b>
	<b>III 2015</b>	<b>816</b>	<b>1.871</b>	<b>282</b>	<b>34</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>441</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>3.444</b>

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	III 2016	III 2015

§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	0	0,0	0	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG	Jahre		Jahre	
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,6		4,9	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,6		54,9	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	4.115	141,7%	3.444	301,6%

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	III 2016	III 2015
§19 (1) Nr.2 PfandBG	0	0
§19 (1) Nr.3 PfandBG	0	0

§ 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	
	III 2016	III 2015	Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
			III 2016	III 2015	III 2016	III 2015				
Bundesrepublik Deutschland	0	0	0	0	0	0	75	140	75	140
Europäische Institutionen	0	0	0	0	0	0	19	27	19	27
<b>Summe</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>94</b>	<b>167</b>	<b>94</b>	<b>167</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 2016	III 2015	III 2016	III 2015
keine	0	0	0	0
<b>Summe</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>