

Stichtag	II 2017
Referenz	II 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*	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	3.166	2.574	3.243	1.751	3.347	1.681
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	4.980	4.018	5.500	4.005	5.635	3.794
% 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 %	57,3%	56,1%	69,6%	128,7%	68,3%	125,6%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
bis zu sechs Monate	40	38	222	196
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	312	55	238	173
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	112	40	253	188
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	410	324	231	192
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	20	528	433	391
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	610	26	453	341
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	20	615	481	381
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	814	871	2.111	1.714
mehr als 10 Jahre	829	78	559	443

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2017	II 2016
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	86,6%	81,8%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	94,7%	92,5%

§ 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	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 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	II 2017	II 2016
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	3.755	3.199
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	469	373
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	423	269
mehr als 10 Mio. €	208	84

nach Nutzungsart (I)	II 2017	II 2016
wohnwirtschaftlich	3.855	3.242
gewerblich	1.000	683

Kennzahlen	II 2017		II 2016	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG				
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	4,5		4,6	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	58,4		55,6	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
Ordentliche Deckung (nominal)	4.855	3.924	153,4%	152,4%

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	II 2017	1.121	2.295	439	189	0	0	811	0	0	4.855
	II 2016	930	1.980	331	150	0	0	533	0	0	3.924
Summe	II 2017	1.121	2.295	439	189	0	0	811	0	0	4.855
	II 2016	930	1.980	331	150	0	0	533	0	0	3.924

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	II 2017	II 2016
§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	
			Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
Bundesrepublik Deutschland	0	0	0	0	0	0	105	75	105	75
Europäische Institutionen	0	0	0	0	0	0	20	19	20	19
Summe	0	0	0	0	0	0	125	94	125	94

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	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
keine	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0