

Stichtag	I 2017
Referenz	I 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*	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	3.202	2.162	3.311	1.751	3.393	1.681
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	4.793	3.801	5.336	4.005	5.440	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 %	49,7%	75,8%	61,1%	128,7%	60,4%	125,6%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
bis zu sechs Monate	65	0	191	159
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	5	63	231	200
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	387	65	235	159
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	380	5	229	188
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	106	450	423	403
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	585	106	445	323
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	45	585	447	372
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	814	861	2.046	1.602
mehr als 10 Jahre	817	28	547	394

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	I 2017	I 2016
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	85,7%	80,5%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	94,8%	91,0%

§ 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	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 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	I 2017	I 2016
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	3.641	3.063
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	441	363
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	391	269
mehr als 10 Mio. €	195	35

nach Nutzungsart (I)	I 2017	I 2016
wohnwirtschaftlich	3.727	3.086
gewerblich	941	644

Kennzahlen	I 2017		I 2016	
§ 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	4,5		4,8	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,6		55,5	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
Ordentliche Deckung (nominal)	4.668	145,8%	3.730	172,6%

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	I 2017	1.077	2.225	425	185	0	0	756	0	0	4.668
	I 2016	876	1.901	309	138	0	0	506	0	0	3.730
Summe	I 2017	1.077	2.225	425	185	0	0	756	0	0	4.668
	I 2016	876	1.901	309	138	0	0	506	0	0	3.730

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	I 2017	I 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					
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
Bundesrepublik Deutschland	0	0	0	0	0	0	105	51	105	51
Europäische Institutionen	0	0	0	0	0	0	20	19	20	19
Summe	0	0	0	0	0	0	125	70	125	70

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	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
keine	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0