

Stichtag	III 2015
Referenz	III 2014

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 2015	III 2014	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	1.141,90	1.204,90	1.258,78	1.344,24	1.213,29	1.294,59
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	3.610,63	3.365,21	4.061,39	3.794,09	3.876,89	3.623,89
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	216,20%	179,29%	222,64%	182,25%	219,53%	179,92%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014
bis zu sechs Monate	10,00	138,50	186,92	177,82
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,00	35,00	152,30	183,11
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	63,00	10,00	182,95	178,93
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	65,00	0,00	150,32	139,23
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	75,30	128,00	400,65	298,57
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	470,10	75,30	397,05	366,89
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	65,00	470,10	358,35	366,79
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	375,50	330,00	1.442,74	1.396,97
mehr als 10 Jahre	18,00	18,00	339,34	256,89

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	III 2015	III 2014
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	76,79	65,79
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	83,19	88,80

§ 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 2015	III 2014	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 2015	III 2014
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	2.967,64	2.738,14
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	303,69	255,00
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	172,31	155,58
mehr als 10 Mio. €	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I)	III 2015	III 2014
wohnwirtschaftlich	2.968,90	2.748,30
gewerblich	474,73	400,41

Kennzahlen	III 2015		III 2014	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG				
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG				
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,85		4,97	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG				
durchschn. gew. Beteiligungsauflauf	54,86		48,63	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014
Ordentliche Deckung (nominal)	3.443,63	3.148,71	301,57%	261,33%

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
Land	III 2015	815,92	1.871,29	281,69	33,69	0,00	0,00	441,04	0,00	0,00	3.443,63
	III 2014	742,29	1.668,30	337,71	0,00	0,00	0,00	400,41	0,00	0,00	3.148,71
Summe	III 2015	815,92	1.871,29	281,69	33,69	0,00	0,00	441,04	0,00	0,00	3.443,63
	III 2014	742,29	1.668,30	337,71	0,00	0,00	0,00	400,41	0,00	0,00	3.148,71

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	III 2015	III 2014
§19 (1) Nr.2 PfandBG	0,00	0,00
§19 (1) Nr.3 PfandBG	0,00	0,00

§ 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 2015	III 2014	Gesamt		davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		III 2015	III 2014	III 2015	III 2014
			III 2015	III 2014	III 2015	III 2014				
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	140,00	140,00	140,00	140,00
Europäische Institutionen	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	27,00	76,50	27,00	76,50
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	167,00	216,50	167,00	216,50

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 2015	III 2014	III 2015	III 2014
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00