

Stichtag	I 2016
Referenz	I 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*	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	2.161,90	1.161,90	2.291,00	1.296,60	2.189,24	1.247,99
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	3.800,72	3.502,84	4.333,84	3.982,37	4.129,75	3.807,65
% 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 %	75,80%	201,48%	89,17%	207,14%	88,64%	205,10%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
bis zu sechs Monate	0,00	35,00	159,29	190,97
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	63,00	10,00	200,35	197,21
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	65,00	0,00	158,87	148,50
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	5,00	63,00	188,30	180,00
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	449,80	70,00	403,05	325,82
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	105,60	444,80	323,11	410,54
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	585,00	110,60	372,31	383,08
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	860,50	420,50	1.601,60	1.398,38
mehr als 10 Jahre	28,00	8,00	393,84	268,35

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	I 2016	I 2015
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	80,49%	71,74%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	91,04%	83,48%

§ 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 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 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	I 2016	I 2015
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	3.062,98	2.843,59
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	363,09	292,47
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	269,48	150,28
mehr als 10 Mio. €	34,92	0,00

nach Nutzungsart (I)	I 2016	I 2015
wohnwirtschaftlich	3.086,45	2.858,07
gewerblich	644,02	428,27

Kennzahlen	I 2016		I 2015	
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG	Jahre		Jahre	
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,70		4,94	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beteiligungsauslauf	55,56		48,82	

Anteil am Gesamtumlauf	I 2016		I 2015	
Ordentliche Deckung (nominal)	3.730,47	172,56%	3.286,33	282,84%

Land	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	I 2016	876,33	1.901,48	308,64	137,85	0,00	0,00	506,17	0,00	0,00	3.730,47
	I 2015	782,43	1.726,37	349,26	0,00	0,00	0,00	428,27	0,00	0,00	3.286,33
Summe	I 2016	876,33	1.901,48	308,64	137,85	0,00	0,00	506,17	0,00	0,00	3.730,47
	I 2015	782,43	1.726,37	349,26	0,00	0,00	0,00	428,27	0,00	0,00	3.286,33

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 2016	I 2015
§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	
	I 2016	I 2015	Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
			I 2016	I 2015	I 2016	I 2015				
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	51,25	140,00	51,25	140,00
Europäische Institutionen	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	19,00	76,50	19,00	76,50
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	70,25	216,50	70,25	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	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00