

Stichtag	III 2016
Referenz	III 2015

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	290,00	285,00	334,37	320,94	290,64	275,52	337,56	337,56
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	572,50	552,99	671,92	637,84	585,00	551,91	675,69	666,01
davon gattungsklassische Deckungswerte	557,50	537,99	656,40	622,20	570,05	537,20	660,21	650,29
davon weitere Deckungswerte	15,00	15,00	15,52	15,64	14,95	14,71	15,48	15,73
Überdeckung in %	97,41%	94,03%	100,95%	98,74%	101,28%	100,31%	100,17%	97,30%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			4,64%					

II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2016		Laufzeitstruktur III 2015		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2016	III 2015
bis zu sechs Monate	27,19	0,00	19,67	0,00	27,19	19,67
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	11,52	30,00	11,04	5,00	-18,48	6,04
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	13,55	0,00	22,15	0,00	13,55	22,15
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	13,90	25,00	10,09	30,00	-11,10	-19,91
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	35,43	10,00	29,00	25,00	25,43	4,00
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	69,51	10,00	34,96	10,00	59,51	24,96
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	64,28	40,00	68,85	10,00	24,28	58,85
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	261,84	115,00	274,85	145,00	146,84	129,85
über 10 Jahre	75,29	60,00	82,38	60,00	15,29	22,38

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung nach	III 2016				III 2015				gesetzl. Grenze
	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		§19 Abs.1 Nr 3 PfandBG 20%- Grenze		Summe	
	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	15,00	15,00	15,00	15,00
Summe	-	-	-	-	15,00	15,00	15,00	15,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
keine	-	-	-	-	-	-

	III 2016	III 2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,19%	99,34%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	98,28%	98,25%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,33%	54,58%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,17	3,60

Stichtag	III 2016
Referenz	III 2015

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	III 2016	III 2015	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2016	III 2015	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	505,19	489,82		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	15,00	15,00	5,17%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	35,77	32,59		davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	16,54	15,58		davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%
mehr als 10 Mio.€	-	-		Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)			
wohnwirtschaftlich	520,53	498,36		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	15,00	15,00	5,17%
gewerblich	36,97	39,63			-	-	0,00%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung			
Eigentumswohnungen	79,32	78,62	13,86%		572,50	552,99	197,41%
Ein- und Zweifamilienhäuser	365,84	352,21	63,90%				
Mehrfamilienhäuser	75,32	67,48	13,16%				
Bürogebäude	5,91	5,90	1,03%				
Handelsgebäude	2,06	2,56	0,36%				
Industriegebäude	20,84	24,01	3,64%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	8,20	7,21	1,43%				
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%				
Bauplätze	-	-	0,00%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 2 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	III 2016	III 2015	III 2016	III 2015
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00