

Stichtag	III 2017
Referenz	III 2016

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 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	270,00	290,00	301,26	334,37	263,64	290,64	312,09	337,56
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	667,43	572,50	746,02	671,92	649,14	585,00	772,94	675,69
davon gattungsklassische Deckungswerte	632,43	557,50	710,60	656,40	619,01	570,05	736,18	660,21
davon weitere Deckungswerte	35,00	15,00	35,42	15,52	30,14	14,95	36,76	15,48
Überdeckung in %	147,20%	97,41%	147,63%	100,95%	146,22%	101,28%	147,66%	100,17%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			4,99%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2017		Laufzeitstruktur III 2016		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2017	III 2016
bis zu sechs Monate	16,69	0,00	27,19	0,00	16,69	27,19
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	16,97	25,00	11,52	30,00	-8,03	-18,48
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	15,78	5,00	13,55	0,00	10,78	13,55
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	18,85	5,00	13,90	25,00	13,85	-11,10
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	71,34	10,00	35,43	10,00	61,34	25,43
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	65,52	40,00	69,51	10,00	25,52	59,51
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	59,86	60,00	64,28	40,00	-0,14	24,28
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	316,25	65,00	261,84	115,00	251,25	146,84
über 10 Jahre	86,18	60,00	75,29	60,00	26,18	15,29

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statistischen 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 2017				III 2016				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert 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 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	35,00	15,00	35,00	15,00
Summe	-	-	-	-	35,00	15,00	35,00	15,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
keine	-	-	-	-	-	-

	III 2017	III 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,23%	99,19%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	98,15%	98,28%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,29%	54,33%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,52	4,17

Stichtag	III 2017
Referenz	III 2016

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	III 2017	III 2016	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	III 2017	III 2016	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	572,20	505,19		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	15,00	12,96%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	41,59	35,77		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	18,64	16,54		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)	15,00	15,00	5,56%
wohnwirtschaftlich	593,96	520,53		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. la PfandBG	20,00	-	7,41%
gewerblich	38,47	36,97		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	667,43	572,50	247,20%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	87,16	79,32	13,06%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	419,36	365,84	62,83%				
Mehrfamilienhäuser	87,44	75,32	13,10%				
Bürogebäude	6,45	5,91	0,97%				
Handelsgebäude	1,94	2,06	0,29%				
Industriegebäude	21,16	20,84	3,17%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	8,93	8,20	1,34%				
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 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00