

Stichtag	I 2017
Referenz	I 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)	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	290,00	295,00	323,20	336,00	284,31	289,68	332,80	344,40
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	625,94	541,93	708,51	634,64	615,56	551,79	729,55	646,04
davon gattungsklassische Deckungswerte	590,94	526,93	672,81	619,07	585,53	536,98	692,53	630,49
davon weitere Deckungswerte	35,00	15,00	35,70	15,56	30,04	14,81	37,01	15,55
Überdeckung in %	115,84%	83,70%	119,22%	88,88%	116,51%	90,48%	119,21%	87,59%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			4,70%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2017		Laufzeitstruktur I 2016		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2017	I 2016
bis zu sechs Monate	17,15	30,00	16,45	5,00	-12,85	11,45
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	13,86	0,00	21,91	0,00	13,86	21,91
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	13,75	25,00	9,81	30,00	-11,25	-20,19
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	16,00	5,00	12,47	0,00	11,00	12,47
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	52,13	15,00	32,52	30,00	37,13	2,52
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	69,51	30,00	51,59	15,00	39,51	36,59
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	61,81	60,00	69,99	30,00	1,81	39,99
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	299,73	65,00	255,36	125,00	234,73	130,36
über 10 Jahre	82,00	60,00	71,83	60,00	22,00	11,83

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	I 2017				I 2016				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	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	35,00	15,00	35,00	15,00
Summe	-	-	-	-	35,00	15,00	35,00	15,00

Nettobarwert je Fremdwahrung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwahrung	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
keine	-	-	-	-	-	-

	I 2017	I 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,24%	99,08%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	98,28%	98,31%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,24%	54,31%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,36	3,96

Stichtag	I 2017
Referenz	I 2016

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2017	I 2016	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	I 2017	I 2016	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	537,46	478,65		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	15,00	12,07%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	36,87	33,10		davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	16,61	15,17		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	5,17%
wohnwirtschaftlich	555,99	487,48		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	20,00	-	6,90%
gewerblich	34,94	39,45		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	625,94	541,93	215,84%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	83,18	76,12	13,29%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	390,46	343,86	62,38%				
Mehrfamilienhäuser	82,35	67,45	13,16%				
Bürogebäude	6,11	7,14	0,98%				
Handelsgebäude	2,08	2,20	0,33%				
Industriegebäude	20,13	22,62	3,22%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	6,62	7,53	1,06%				
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	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00