



Stichtag: 31.12.2016

### 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)	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	200,10	200,10	231,54	232,42	205,60	203,40	233,61	239,19
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	637,03	580,60	730,38	669,11	639,87	583,53	745,19	695,77
davon gattungsklassische Deckungswerte	622,03	565,60	715,23	654,02	625,14	568,93	730,11	680,67
davon weitere Deckungswerte	15,00	15,00	15,15	15,09	14,74	14,59	15,08	15,10
Überdeckung in %	218,35%	190,16%	215,44%	187,89%	211,22%	186,88%	218,99%	190,89%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,54%	6,49%				

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2016		Laufzeitstruktur IV 2015		Überhang	
	Deckungs-masse	Pfandbrief-umlauf	Deckungs-masse	Pfandbrief-umlauf	IV 2016	IV 2015
bis zu 6 Monate	36,45	10,00	26,18	5,00	26,45	21,18
mehr als 6 Monate bis zu zwölf Monaten	14,63	0,00	13,04	0,00	14,63	13,04
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	21,37	5,00	20,93	10,00	16,37	10,93
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,08	0,00	13,22	0,00	20,08	13,22
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	43,26	0,00	39,01	5,00	43,26	34,01
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	64,88	20,00	43,21	0,00	44,88	43,21
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	56,94	85,10	59,85	20,00	-28,16	39,85
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	311,55	75,00	303,60	155,10	236,55	148,50
über 10 Jahre	67,86	5,00	61,58	5,00	62,86	56,58

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) statisches Verfahren gem. PfandBarwertIV

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

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung nach	IV 2016				IV 2015				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	0,00			0,00	0,00			0,00	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	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	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	15,00	15,00	15,00	15,00
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>15,00</b>	<b>15,00</b>	<b>15,00</b>	<b>15,00</b>

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	IV 2016	IV 2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,52%	96,36%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,13%	54,28%
Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	0,00	0,00
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	5,12	4,66

**IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse** (Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	IV 2016	IV 2015	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2016	IV 2015	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumschlages
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	440,77	410,98	69,19%	weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	90,17	81,22	14,15%	davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio.€	91,09	73,41	14,30%	davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	0,00	0,00%
mehr als 10 Mio.€	0,00	0,00	0,00%	Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)			
wohnwirtschaftlich	529,16	484,17	83,07%	Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	92,87	81,44	14,58%				
				<b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>	<b>637,03</b>	<b>580,60</b>	<b>318,35%</b>
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Eigentumswohnungen	93,94	85,63	14,75%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	300,23	283,40	47,13%				
Mehrfamilienhäuser	137,80	118,11	21,63%				
Bürogebäude	17,34	10,83	2,72%				
Handelsgebäude	5,33	3,31	0,84%				
Industriegebäude	28,50	26,33	4,47%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	38,88	38,01	6,10%				
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%				
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

**V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 2 Pfandbriefgesetz** (Angaben in Mio. Euro)

	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
Bundesrepublik Deutschland				
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>