



Stichtag: 31.12.2017

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 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	190,10	200,10	214,96	231,54	194,05	205,60	217,67	233,61
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	609,79	637,03	682,48	730,38	600,29	639,87	703,73	745,19
davon gattungsklassische Deckungswerte	594,79	622,03	667,36	715,23	585,45	625,14	688,67	730,11
davon weitere Deckungswerte	15,00	15,00	15,12	15,15	14,83	14,74	15,06	15,08
Überdeckung in %	220,77%	218,35%	217,49%	215,44%	209,35%	211,22%	223,30%	218,99%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,04%	6,54%				

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2017		Laufzeitstruktur IV 2016		Überhang	
	Deckungs-masse	Pfandbrief-umlauf	Deckungs-masse	Pfandbrief-umlauf	IV 2017	IV 2016
bis zu 6 Monate	31,73	5,00	36,45	10,00	26,73	26,45
mehr als 6 Monate bis zu zwölf Monaten	16,22	0,00	14,63	0,00	16,22	14,63
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	15,80	0,00	21,37	5,00	15,80	16,37
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	21,74	0,00	20,08	0,00	21,74	20,08
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	61,28	20,00	43,26	0,00	41,28	43,26
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	54,18	85,10	64,88	20,00	-30,92	44,88
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	59,93	20,00	56,94	85,10	39,93	-28,16
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	291,78	55,00	311,55	75,00	236,78	236,55
über 10 Jahre	57,14	5,00	67,86	5,00	52,14	62,86

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 2017				IV 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	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 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	15,00	15,00	15,00	15,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	15,00	15,00	15,00	15,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	IV 2017	IV 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,65%	96,52%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	53,90%	54,13%
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	5,65	5,12

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse							(Angaben in Mio. Euro)		
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	IV 2017	IV 2016	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2017	IV 2016	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumschlages		
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte					
bis einschließlich 300 T€	438,04	440,77	71,83%	weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	15,00	15,00	7,89%		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	85,16	90,17	13,96%	davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%		
mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio.€	71,59	91,09	11,74%	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	527,68	529,16	86,53%	Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	15,00	15,00	7,89%		
gewerblich	67,11	92,87	11,01%		0,00	0,00	0,00%		
					Summe gattungsklassische und weitere Deckung				
					609,79	637,03	320,77%		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland									
Eigentumswohnungen	93,07	93,94	15,26%						
Ein- und Zweifamilienhäuser	305,06	300,23	50,03%						
Mehrfamilienhäuser	129,55	137,80	21,24%						
Bürogebäude	17,48	17,34	2,87%						
Handelsgebäude	2,22	5,33	0,36%						
Industriegebäude	19,02	28,50	3,12%						
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	28,38	38,88	4,65%						
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)	
Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag		IV 2017	IV 2016
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016		
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00		
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00		