

Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 30.06.2017

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

PfandBG § 28 (1) Nr. 1 und 3

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert ¹⁾	
	30.06.2017	30.06.2016	30.06.2017	30.06.2016	30.06.2017	30.06.2016
Hypothekendarlehen	5.410,0	4.872,0	6.029,7	5.692,1	5.606,4	5.378,7
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	7.156,8	6.695,3	7.943,7	7.696,3	7.429,8	7.329,6
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	1.746,8	1.823,4	1.914,0	2.004,2	1.823,4	1.951,0
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-

¹⁾ Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. PfandBarwertV verwendet.

PfandBG § 28 (1) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	Laufzeitenstruktur des Hypothekendarlehens		Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse		davon weitere Deckungswerte	
	30.06.2017	30.06.2016	30.06.2017	30.06.2016	30.06.2017	30.06.2016
<= 0,5 Jahre	165,0	318,0	314,4	312,3	-,-	-,-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	88,0	178,5	277,5	316,4	-,-	-,-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	244,2	154,0	300,4	345,8	-,-	-,-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	230,0	88,0	407,5	298,1	-,-	-,-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	637,5	456,2	696,6	713,5	-,-	-,-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	332,7	626,8	696,7	616,4	-,-	-,-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	649,7	331,8	673,9	620,0	-,-	-,-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.253,1	1.831,7	2.801,3	2.464,6	200,0	100,0
> 10 Jahre	810,0	887,0	988,6	1.008,3	-,-	100,0

PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	30.06.2017	30.06.2016
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	97,2	97,0
Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	99,1	99,0

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

PfandBG § 28 (2) Nr. 1

Angaben in Mio. EUR

a) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	30.06.2017	30.06.2016
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	3.075,3	3.222,6
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.235,7	1.069,0
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.131,4	1.897,4
Mehr als 10 Mio. EUR	514,5	306,4

b) und c) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Nutzungsart und nach Staaten²⁾

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	30.06.2017	30.06.2016	30.06.2017	30.06.2016
Eigentumswohnungen	793,0	807,9	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	2.165,9	2.140,6	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.144,4	2.058,9	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	784,1	538,7
Handelsgebäude	-,-	-,-	317,3	249,4
Industriegebäude	-,-	-,-	25,2	24,1
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	727,0	675,8
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

²⁾ keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	30.06.2017	30.06.2016
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) überschreiten (in Mio. EUR)	0,0	0,0
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (in Jahren)	6,2	6,1

PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	30.06.2017	30.06.2016
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)	52,0	51,9

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2017	30.06.2016
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 2 übersteigen	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 3 übersteigen	0,0	0,0

PfandBG § 28 (1) Nr. 4, 5 und 6

	30.06.2017	30.06.2016
Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2	0,0	0,0
<i>davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d.Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013</i>	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 3	200,0	200,0

IV) Übersicht der rückständigen Leistungen

PfandBG § 28 (2) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2017	30.06.2016
Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen	0,0	0,0
Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	0,0	0,0