

## Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 30.09.2017

### I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 1, 3 und 10

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert <sup>1)</sup>	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
Hypothekendarlehen	5.458,3	5.078,0	6.070,9	5.927,4	5.733,6	5.593,6
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	7.182,1	6.951,4	7.949,2	7.970,1	7.542,5	7.591,3
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	1.723,8	1.873,4	1.878,4	2.042,7	1.808,9	1.997,7
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-

<sup>1)</sup> Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. PfandBarwertV verwendet.

Der Ausweis der Nettobarwerte je Fremdwährung entfällt, da der Deckungsmasse ausschließlich Geschäfte auf Euro-Basis zugrundeliegen.

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	Laufzeitenstruktur des Hypothekendarlehens		Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse		davon weitere Deckungswerte	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
<= 0,5 Jahre	165,0	215,0	251,7	296,9	-,-	-,-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	181,2	153,5	288,1	362,3	-,-	-,-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	187,0	140,0	364,7	296,2	-,-	-,-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	355,0	181,2	356,5	305,0	-,-	-,-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	459,0	517,0	683,8	782,2	-,-	-,-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	341,7	453,3	732,3	638,4	-,-	-,-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	667,3	340,8	694,1	683,5	-,-	-,-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.400,3	2.164,2	2.864,3	2.530,6	200,0	100,0
> 10 Jahre	702,0	913,0	946,7	1.056,3	-,-	100,0

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	30.09.2017	30.09.2016
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	97,2	97,1
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	30.09.2017	30.09.2016
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	3.027,2	3.207,7
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.273,8	1.156,4
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.176,2	2.009,5
Mehr als 10 Mio. EUR	505,0	377,9

### b) und c) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Nutzungsart und nach Staaten<sup>2)</sup>

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
Eigentumswohnungen	786,2	811,0	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	2.151,9	2.138,7	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.146,6	2.141,8	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	855,3	620,6
Handelsgebäude	-,-	-,-	349,9	292,7
Industriegebäude	-,-	-,-	46,7	26,9
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	645,5	719,8
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

<sup>2)</sup> keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

### PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	30.09.2017	30.09.2016
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	6,0

### PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	30.09.2017	30.09.2016
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)*	51,9	52,1

### III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	30.09.2017	30.09.2016
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

	30.09.2017	30.09.2016
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

	30.09.2017	30.09.2016
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