

Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 31.03.2017

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

PfandBG § 28 (1) Nr. 1 und 3

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert ¹⁾	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
Hypothekendarlehen	4.962,5	4.838,0	5.631,6	5.633,9	4.636,5	5.781,7
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	7.112,2	6.126,7	7.951,4	7.056,7	6.706,6	7.177,2
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	2.149,7	1.288,8	2.319,8	1.422,9	2.070,1	1.395,5
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	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
<= 0,5 Jahre	153,5	214,0	331,3	248,8	-,-	-,-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	140,0	200,0	267,2	313,0	-,-	-,-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	181,2	153,5	283,0	332,7	-,-	-,-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	187,0	140,0	377,1	297,8	-,-	-,-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	614,1	370,2	737,4	620,2	-,-	-,-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	414,0	610,8	663,4	622,1	-,-	-,-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	664,8	416,3	714,6	556,3	-,-	-,-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.725,0	1.786,2	2.746,2	2.234,1	200,0	100,0
> 10 Jahre	883,0	947,0	992,1	901,5	-,-	100,0

PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	31.03.2017	31.03.2016
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	97,2	96,7
Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	99,0	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	31.03.2017	31.03.2016
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	3.132,2	3.165,5
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.226,4	928,8
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.092,4	1.558,3
Mehr als 10 Mio. EUR	461,2	274,1

b) und c) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Nutzungsart und nach Staaten ²⁾

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
Eigentumswohnungen	796,4	783,2	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	2.106,3	2.096,6	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.233,3	1.805,5	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	745,0	426,7
Handelsgebäude	-,-	-,-	307,3	208,7
Industriegebäude	-,-	-,-	24,6	22,4
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	699,3	583,6
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

²⁾ keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	31.03.2017	31.03.2016
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)	6,1	6,1

PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	31.03.2017	31.03.2016
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)	52,0	51,6

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	31.03.2017	31.03.2016
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

	31.03.2017	31.03.2016
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

	31.03.2017	31.03.2016
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