

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	60,00	110,00	64,34	116,95	57,86	107,20	65,60	116,97
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	328,93	330,33	345,62	355,22	317,33	328,60	352,76	356,25
davon gattungsklassische Deckungswerte	326,63	326,33	343,30	351,20	315,14	324,61	350,43	352,23
davon sonstige Deckungswerte	2,30	4,00	2,32	4,02	2,19	3,98	2,33	4,02
Überdeckung in %	448,22%	200,30%	437,21%	203,75%	448,40%	206,51%	437,74%	204,56%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			3,60%					

*Der Risikobarwert wird nach statischem Verfahren gem. Pfandbrief-Barwertverordnung ermittelt (Zinskurve + / - 250 BP).

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

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2017			II 2016		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	61,58	-	61,58	87,08	5,00	82,08
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	12,13	15,00	- 2,87	11,32	-	11,32
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	20,33	-	20,33	1,66	-	1,66
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	4,06	10,00	- 5,94	17,95	15,00	2,95
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	57,81	-	57,81	24,72	60,00	- 35,28
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	49,22	-	49,22	42,43	-	42,43
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	27,64	-	27,64	48,20	-	48,20
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	56,75	35,00	21,75	70,46	30,00	40,46
über 10 Jahre	39,41	-	39,41	26,51	-	26,51

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

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2017	II 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	75,58%	66,96%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

Barwerte je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
keine	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	II 2017				II 2016			
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf
§20 PfandBG Abs. 2 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-
§20 PfandBG Abs. 2 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach Art der gesetzlichen Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen*	
	II 2017	II 2016	II 2017	II 2016
keine	-	-	-	-

* i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1-2 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	II 2017	II 2016
bis zu 10 Millionen €	72,43	72,27
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	256,50	258,06
mehr als 100 Millionen €	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -*	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	II 2017	-	2,30	150,60	124,67	277,57
Spanien	II 2017	0,00	-	-	-	0,00
Bundesrepublik Deutschland	II 2016	-	-	-	-	-
Spanien	II 2016	-	-	-	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -*	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	II 2017	-	22,93	28,43	-	51,36
Spanien	II 2017	-	-	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	II 2016	-	-	-	-	-
Spanien	II 2016	-	-	-	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	II 2017	-	25,23	179,04	124,67	328,93
Spanien	II 2017	0,00	-	-	-	0,00
Bundesrepublik Deutschland	II 2016	-	27,34	168,90	133,08	329,33
Spanien	II 2016	1,00	-	-	-	1,00

Weitere Deckungswerte	II 2017	Anteil am Pfandbriefumlauf	II 2016	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	328,93	548,22%	330,33	300,30%

* Neue Tabelle für die keine Vorjahreswerte vorliegen.

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 zu rückständigen Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen auf Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
keine	II 2017	-	-	-	-	-
keine	II 2016	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
keine	II 2017	-	-	-	-	-
keine	II 2016	-	-	-	-	-