

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	60,00	110,00	64,30	117,04	58,16	107,95	65,38	116,75
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	335,43	341,68	352,89	367,02	324,64	339,98	360,38	367,05
davon gattungsklassische Deckungswerte	333,13	336,43	350,57	361,67	322,44	334,95	358,05	361,72
davon sonstige Deckungswerte	2,30	5,25	2,32	5,35	2,20	5,04	2,33	5,34
Überdeckung in %	459,04%	210,62%	448,86%	213,59%	458,19%	214,94%	451,17%	214,38%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			3,61%					

*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)

	III 2017			III 2016		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	60,71	-	60,71	77,20	5,00	72,20
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	19,36	15,00	4,36	11,27	-	11,27
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	14,50	-	14,50	9,72	-	9,72
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	34,23	10,00	24,23	26,43	15,00	11,43
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	28,15	-	28,15	47,93	60,00	12,07
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	49,58	-	49,58	22,44	-	22,44
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	28,11	-	28,11	47,95	-	47,95
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	58,39	35,00	23,39	71,48	30,00	41,48
über 10 Jahre	42,40	-	42,40	27,26	-	27,26

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2017	III 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	76,24%	71,08%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

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

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	III 2017				III 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*	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 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	III 2017	III 2016
bis zu 10 Millionen €	74,17	63,27
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	261,26	278,41
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	III 2017	-	2,30	152,76	129,39	284,45
Spanien	III 2017	0,00	-	-	-	0,00
Bundesrepublik Deutschland	III 2016	-	-	-	-	-
Spanien	III 2016	-	-	-	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -*	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	III 2017	-	22,57	28,41	-	50,98
Spanien	III 2017	-	-	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	III 2016	-	-	-	-	-
Spanien	III 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	III 2017	-	24,87	181,17	129,39	335,43
Spanien	III 2017	0,00	-	-	-	0,00
Bundesrepublik Deutschland	III 2016	-	28,25	179,95	132,48	340,68
Spanien	III 2016	1,00	-	-	-	1,00

Weitere Deckungswerte	III 2017	Anteil am Pfandbriefumlauf	III 2016	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	335,43	559,04%	341,68	310,62%

* 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	III 2017	-	-	-	-	-
keine	III 2016	-	-	-	-	-

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