

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	I 2016	Referenz	I 2015
----------	--------	----------	--------

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	72,20	75,20	85,63	90,68	78,15	81,35	86,16	92,17
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	271,65	358,16	306,20	406,21	264,17	353,98	314,75	417,90
davon gattungsklassische	266,65	353,16	300,66	400,68	259,46	349,38	309,13	412,20
davon weitere Deckungswerte	5,00	5,00	5,54	5,52	4,72	4,60	5,61	5,70
Überdeckung in %	276,25%	376,28%	257,57%	347,97%	238,03%	335,13%	265,29%	353,40%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			6,47%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2016		Laufzeitstruktur Referenz		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2016	I 2015
bis zu sechs Monate	5,37	25,00	19,40	-	-19,63	19,40
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	6,00	-	44,61	3,00	6,00	41,61
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	4,55	-	13,82	25,00	4,55	- 11,18
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	12,38	-	8,37	-	12,38	8,37
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	28,09	-	21,67	-	28,09	21,67
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	26,17	11,00	22,80	-	15,17	22,80
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	22,06	-	20,54	11,00	22,06	9,54
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	137,19	36,20	160,97	31,20	100,99	129,77
über 10 Jahre	29,84	-	45,99	5,00	29,84	40,99

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse) (Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Deckung nach	I 2016				I 2015			
	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 gesetzl. Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
keine	-	-	-	-	-	-

	I 2016	I 2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	89,90%	92,13%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

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

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2016	I 2015
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	271,65	358,16

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	I 2016	I 2015
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	I 2016	I 2015
bis zu 10 Millionen €	50,44	÷
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	221,21	÷
mehr als 100 Millionen €	-	÷

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015	I 2016	I 2015
Bundesrepublik Deutschland	-	-	25,00	5,00	209,76	246,96	36,89	106,20	271,65	358,16

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 3 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2016	I 2015
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	-	-

Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörpe	Örtliche Gebietskörpe	Sonstige Schuldner	Summe
	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörpe	Örtliche Gebietskörpe	Sonstige Schuldner	Summe
	-	-	-	-	-