

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	60,00	110,00	65,63	115,97	58,38	105,21	66,51	117,88
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	358,79	342,95	381,27	371,15	350,40	341,97	386,02	377,54
davon gattungsklassische Deckungswerte	357,29	338,95	379,77	367,13	348,89	337,99	384,52	373,52
davon sonstige Deckungswerte	1,50	4,00	1,51	4,02	1,50	3,97	1,50	4,02
Überdeckung in %	497,98%	211,77%	480,92%	220,03%	500,18%	225,03%	480,38%	220,27%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			2,29%					

*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)

	IV 2016			IV 2015		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	77,84	-	77,84	79,38	-	79,38
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	9,33	-	9,33	10,23	5,00	5,23
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	12,06	15,00	- 2,94	15,14	-	15,14
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	29,46	-	29,46	10,39	-	10,39
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	51,86	10,00	41,86	19,65	65,00	- 45,35
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	13,77	-	13,77	30,77	10,00	20,77
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	49,17	-	49,17	37,40	-	37,40
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	75,69	35,00	40,69	114,24	30,00	84,24
über 10 Jahre	39,61	-	39,61	25,74	-	25,74

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

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2016	IV 2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	73,46%	73,42%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

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

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	IV 2016				IV 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 gesetzlichen Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen*	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
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	IV 2016	IV 2015
bis zu 10 Millionen €	61,62	80,91
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	297,17	262,03
mehr als 100 Millionen €	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	IV 2016	-	25,15	206,78	126,86	358,79
Spanien	IV 2016	0,00	-	-	-	0,00
Bundesrepublik Deutschland	IV 2015	-	28,03	162,87	151,05	341,95
Spanien	IV 2015	1,00	-	-	-	1,00

Weitere Deckungswerte	IV 2016	Anteil am Pfandbriefumlauf	IV 2015	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	358,79	597,98%	342,95	311,77%

* 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 Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
keine	IV 2016	-	-	-	-	-
keine	IV 2015	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
keine	IV 2016	-	-	-	-	-
keine	IV 2015	-	-	-	-	-