



**Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2016	Q3 2015	Q3 2016	Q3 2015	Q3 2016	Q3 2015
<b>Hypothekendarfandbriefe</b>	Mio. €	1.856,0	2.363,6	2.247,4	2.777,4	2.069,1	2.911,7
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	Mio. €	3.034,8	3.269,5	3.204,9	3.451,1	2.918,7	3.497,9
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	Mio. €	1.178,8	905,9	957,5	673,7	849,6	586,3
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		63,52	38,33	42,61	24,26	41,06	20,13

\* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 PfandBarwertV verwendet.

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2016	Q3 2015	Q3 2016	Q3 2015	Q3 2016	Q3 2015
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	Mio. €	1.302,4	1.662,4	1.554,4	1.937,5	1.685,3	2.024,8
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	Mio. €	2.312,9	2.273,4	2.397,9	2.387,1	2.485,3	2.445,7
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	Mio. €	1.010,5	611,0	843,5	449,7	800,0	420,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		77,59	36,75	54,26	23,21	47,47	20,78

\* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 PfandBarwertV verwendet.

**Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen**

Hypothekendarfandbriefe	Q3 2016				Q3 2015			
	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
<b>Restlaufzeit:</b>								
≤ 0,5 Jahre	102,0	139,8	336,6	453,7				
> 0,5 Jahre und ≤ 1 Jahr	95,0	379,4	161,0	234,6				
> 1 Jahr und ≤ 1,5 Jahre	42,5	473,3	102,0	220,4				
> 1,5 Jahre und ≤ 2 Jahre	142,3	212,6	95,0	393,8				
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	778,4	430,9	184,8	664,8				
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	94,0	282,3	778,4	424,4				
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	5,0	443,5	94,0	279,4				
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	340,0	673,0	320,0	598,3				
> 10 Jahre	256,8	-	291,8	-				

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2016				Q3 2015			
	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
<b>Restlaufzeit:</b>								
≤ 0,5 Jahre	101,0	293,9	46,0	252,0				
> 0,5 Jahre und ≤ 1 Jahr	191,0	266,5	564,0	313,5				
> 1 Jahr und ≤ 1,5 Jahre	15,0	226,8	101,0	170,3				
> 1,5 Jahre und ≤ 2 Jahre	8,0	891,6	191,0	193,3				
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	450,7	400,6	23,0	952,8				
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	108,2	55,9	200,7	160,4				
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	55,0	27,3	108,2	53,2				
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	167,0	145,9	167,0	168,6				
> 10 Jahre	206,5	4,6	261,5	9,4				

**Weitere Deckungswerte für Hypothekendarfandbriefe und Öffentliche Pfandbriefe**

Hypothekendarfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3	Q3 2016 Mio. €	Q3 2015 Mio. €
Deckungsaktiva	70,0	145,0

Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2	Q3 2016 Mio. €	Q3 2015 Mio. €
Deckungsaktiva	-	-

**Zur Deckung von Hypothekendarfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen**

Deckungswerte	Q3 2016 Mio. €	Q3 2015 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	4,5	7,9
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	28,2	42,2
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	562,8	744,3
Mehr als 10 Mio. €	2.369,3	2.330,0
<b>Summe</b>	<b>2.964,8</b>	<b>3.124,5</b>

**Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen**

Deckungswerte	Q3 2016 Mio. €	Q3 2015 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	207,4	221,3
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.105,5	2.052,1
Mehr als 100 Mio. €	-	-
<b>Summe</b>	<b>2.312,9</b>	<b>2.273,4</b>



Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

Staat	3. Quartal	Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand 5% der Forderung beträgt	
		Insgesamt	Wohnwirtschaftlich								Gewerblich							
			Insgesamt	davon					Insgesamt	davon								
				Wohnungen	Einfamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze			
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2016	2.964,8	532,6	7,1	0,3	525,3	-	-	2.432,2	1.367,1	824,9	-	240,2	-	-	-	-	
	Jahr 2015	3.124,5	798,7	2,3	0,4	795,9	-	-	2.325,8	1.127,3	1.081,2	-	117,3	-	-	-	-	
<b>Deutschland</b>	Jahr 2016	1.588,6	532,6	7,1	0,3	525,3	-	-	1.056,0	316,8	527,0	-	212,2	-	-	-	-	
	Jahr 2015	1.927,9	736,6	2,3	0,4	733,8	-	-	1.191,4	293,8	808,3	-	89,3	-	-	-	-	
<b>Belgien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Bulgarien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Dänemark</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Estland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Finnland</b>	Jahr 2016	365,8	-	-	-	-	-	-	365,8	262,2	75,6	-	28,0	-	-	-	-	
	Jahr 2015	342,3	11,6	-	-	11,6	-	-	330,7	259,0	43,7	-	28,0	-	-	-	-	
<b>Frankreich</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Griechenland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Großbritannien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Irland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Italien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Lettland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Litauen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Malta</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Niederlande</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	74,4	-	-	-	-	-	-	74,4	74,4	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Österreich</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Polen</b>	Jahr 2016	140,5	-	-	-	-	-	-	140,5	44,0	96,5	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	176,1	-	-	-	-	-	-	176,1	79,6	96,5	-	-	-	-	-	-	
<b>Portugal</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Rumänien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Schweden</b>	Jahr 2016	869,9	-	-	-	-	-	-	869,9	744,1	125,8	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	603,7	50,5	-	-	50,5	-	-	553,2	420,5	132,7	-	-	-	-	-	-	
<b>Slowakei</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Slowenien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Spanien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Tschechien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	



Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

		Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand 5% der Forderung beträgt
		Insgesamt	davon														
			Wohnwirtschaftlich							Gewerblich							
			Insgesamt	davon				Insgesamt	davon								
	Wohnungen	Einfamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze					
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Ungarn	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Zypern	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Island	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Liechtenstein	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Norwegen	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Schweiz	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Japan	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Kanada	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
USA	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Sonstige OECD-Staaten	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
EU-Institutionen	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen  
als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt

Staat	3. Quartal	Deckungswerte										Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von				Summe	davon				Summe	davon			
				Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2016	2.312,9	32,2	235,2	364,7	1.595,4	117,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	2.273,4	35,9	257,6	616,0	1.088,6	311,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2016	2.159,2	32,2	185,2	364,7	1.491,7	117,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	2.090,9	35,9	188,9	605,6	1.029,7	266,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Bulgarien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Estland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	Jahr 2016	152,4	-	50,0	-	102,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	177,7	-	68,7	10,4	54,2	44,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Griechenland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Irland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Lettland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Litauen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Malta</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	Jahr 2016	1,3	-	-	-	1,3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	1,8	-	-	-	1,8	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Polen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Portugal</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Rumänien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	3,0	-	-	-	3,0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Slowakei</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Slowenien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zypern</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Island</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Liechtenstein</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen  
als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt

Staat	3. Quartal	Deckungswerte										Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von				Summe	davon				Summe	davon			
				Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Japan	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Kanada	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
USA	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Sonstige OECD-Staaten	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
EU-Institutionen	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

## Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

## 3. Quartal 2016

		Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3				
		Summe	davon			Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3 i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2 Ingesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - all		70,0	-	-	-	70,0
Jahr 2016		70,0	-	-	-	70,0
Jahr 2015		145,0	-	-	-	145,0
Deutschland		70,0	-	-	-	70,0
Jahr 2016		70,0	-	-	-	70,0
Jahr 2015		145,0	-	-	-	145,0
Belgien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Bulgarien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Dänemark		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Estland		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Finnland		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Frankreich		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Griechenland		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Großbritannien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Irland		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Italien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Lettland		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Litauen		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Luxemburg		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Malta		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Niederlande		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Österreich		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Polen		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Portugal		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Rumänien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Schweden		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Slowakei		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Slowenien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Spanien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Tschechien		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Ungarn		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Zypern		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Island		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Liechtenstein		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Norwegen		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Schweiz		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Japan		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Kanada		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
USA		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
EU-Institutionen		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-
Übrige Staaten/Inseln		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Jahr 2015		-	-	-	-	-

## Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

## 3. Quartal 2016

		Weitere Deckungswerte für öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr.2			
		Summe	davon		
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2	
				Ingesamt	davon
					gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - al</b>		-	-	-	-
	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Bulgarien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Estland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Griechenland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Irland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Italien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Lettland</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Litauen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Malta</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Polen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Portugal</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Rumänien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Slowakei</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Slowenien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Zypern</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Island</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Liechtenstein</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Japan</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>USA</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Sonstige OECD-Sta</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>EU-Institutionen</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
<b>Übrige Staaten/Ins</b>	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-



Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

3. Quartal 2016

**Hypothekendarlehen**

		Q3 2016	Q3 2015
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	1.856,0	2.363,6
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	93,56	91,14
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	3.034,8	3.269,5
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten § 28 Abs. 1 Nr. 7	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	40,00	48,77
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	869,9	618,3
	USD	-	-
...	-	-	
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 1 Nr. 11	Jahre	4,4	5,1
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	46,77	48,88
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-

**Öffentliche Pfandbriefe**

		Q3 2016	Q3 2015
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	1.302,4	1.662,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,00	100,00
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	2.312,9	2.273,4
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	83,58	86,89
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
...	-	-	