

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen	Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*		
	Q4 2016	Q4 2015	Q4 2016	Q4 2015	Q4 2016	Q4 2015	
Hypothekendarbriefe	Mio. €	1.746,0	2.208,4	2.098,6	2.618,0	1.955,8	2.758,8
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	Mio. €	2.928,2	3.119,3	3.076,0	3.285,3	2.830,2	3.510,8
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	Mio. €	1.182,3	910,9	977,4	667,3	874,4	752,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		67,72	41,25	46,57	25,49	44,71	27,26

* 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*		
	Q4 2016	Q4 2015	Q4 2016	Q4 2015	Q4 2016	Q4 2015	
Öffentlichen Pfandbriefe	Mio. €	1.202,4	1.881,4	1.416,1	2.141,7	1.513,6	2.239,3
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	Mio. €	1.862,0	2.606,1	1.917,2	2.711,4	1.983,2	2.779,4
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	Mio. €	659,6	724,7	501,1	569,7	469,6	540,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		54,86	38,52	35,38	26,60	31,03	24,12

* 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

Hypothekendarbriefe	Q4 2016		Q4 2015	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
≤ 0,5 Jahre	52,0	174,4	283,4	424,7
> 0,5 Jahre und ≤ 1 Jahr	60,0	359,2	159,0	203,7
> 1 Jahr und ≤ 1,5 Jahre	97,5	428,3	52,0	285,2
> 1,5 Jahre und ≤ 2 Jahre	83,3	138,8	60,0	387,5
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	806,4	413,3	180,8	573,1
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	55,0	304,6	806,4	457,3
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	70,0	407,5	55,0	218,9
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	275,0	702,2	320,0	568,7
> 10 Jahre	246,8	-	291,8	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q4 2016		Q4 2015	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
≤ 0,5 Jahre	169,0	227,0	368,0	333,9
> 0,5 Jahre und ≤ 1 Jahr	48,0	166,9	301,0	463,1
> 1 Jahr und ≤ 1,5 Jahre	8,0	337,9	169,0	229,1
> 1,5 Jahre und ≤ 2 Jahre	280,0	699,7	48,0	302,5
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	240,7	231,5	288,0	944,1
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	93,2	27,4	240,7	133,8
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	5,0	27,4	93,2	27,3
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	167,5	144,2	167,0	166,6
> 10 Jahre	191,0	-	206,5	5,6

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarbriefe und Öffentliche Pfandbriefe

Hypothekendarbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3	Q4 2016 Mio. €	Q4 2015 Mio. €
Deckungsaktiva	65,0	175,0

Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2	Q4 2016 Mio. €	Q4 2015 Mio. €
Deckungsaktiva	-	55,0

Zur Deckung von Hypothekendarbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen

Deckungswerte	Q4 2016 Mio. €	Q4 2015 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	4,3	7,4
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	25,6	37,5
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	543,2	691,2
Mehr als 10 Mio. €	2.290,1	2.208,2
Summe	2.863,2	2.944,3

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen

Deckungswerte	Q4 2016 Mio. €	Q4 2015 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	185,8	213,5
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	1.676,2	2.337,6
Mehr als 100 Mio. €	-	-
Summe	1.862,0	2.551,1



Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliebigen 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	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2016	2.863,2	540,4	7,1	0,3	533,1	-	-	2.322,8	1.354,4	711,6	-	256,9	-	-	-	-	
	Jahr 2015	2.944,3	543,4	2,3	0,4	540,6	-	-	2.400,9	1.295,0	948,2	-	157,7	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2016	1.596,1	540,4	7,1	0,3	533,1	-	-	1.055,6	312,1	514,6	-	228,8	-	-	-	-	
	Jahr 2015	1.744,6	543,4	2,3	0,4	540,6	-	-	1.201,2	399,0	672,5	-	129,7	-	-	-	-	
Belgien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Bulgarien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Dänemark	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Estland	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Finnland	Jahr 2016	365,8	-	-	-	-	-	-	365,8	262,2	75,6	-	28,0	-	-	-	-	
	Jahr 2015	340,3	-	-	-	-	-	-	340,3	268,6	43,7	-	28,0	-	-	-	-	
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	74,4	-	-	-	-	-	-	74,4	74,4	-	-	-	-	-	-	-	
Österreich	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Polen	Jahr 2016	44,0	-	-	-	-	-	-	44,0	44,0	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	176,1	-	-	-	-	-	-	176,1	79,6	96,5	-	-	-	-	-	-	
Portugal	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Rumänien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Schweden	Jahr 2016	857,4	-	-	-	-	-	-	857,4	736,1	121,3	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	608,8	-	-	-	-	-	-	608,8	473,3	135,5	-	-	-	-	-	-	
Slowakei	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Slowenien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Spanien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	



Zur Deckung von Hypothekenpfandbriefen 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	4. Quartal	Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindes- tens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand 5% der Forderung beträgt	
		Insgesamt	davon															
			Wohnwirtschaftlich							Gewerblich								
			Insgesamt	davon						Insgesamt	davon							
Wohnungen	Einfamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser		Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	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. €	Mio. €	
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/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

	Deckungswerte	davon geschuldet von										davon gewährleistet von					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe												Summe					Summe							
		In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige				
4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €					
Staat	4. Quartal																									
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2016	1.862,0	30,3	84,9	256,5	1.405,0	115,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	2.551,1	34,1	249,9	708,7	1.383,7	208,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Deutschland	Jahr 2016	1.716,1	30,3	40,3	256,5	1.303,8	115,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	2.376,5	34,1	187,1	698,3	1.326,5	164,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Belgien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Bulgarien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Dänemark	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Estland	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Finnland	Jahr 2016	144,6	-	44,6	-	99,9	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	169,9	-	62,9	10,4	52,4	44,2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
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	1,3	-	-	-	1,3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	1,8	-	-	-	1,8	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Polen	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Portugal	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Rumänien	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
Schweden	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
	Jahr 2015	3,0	-	-	-	3,0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					

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

	Deckungswerte	davon geschuldet von										Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe		davon geschuldet von					davon gewährleistet von					Summe		davon					
		In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige			
Staat	4. Quartal	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

4. Quartal 2016

		Weitere Deckungswerte für Hypothekenpfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3				
		Summe	davon		Forderungen 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		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
Staat	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - al						
	Jahr 2016	65,0	-	-	65,0	
	Jahr 2015	175,0	-	-	175,0	
Deutschland	Jahr 2016	65,0	-	-	65,0	
	Jahr 2015	175,0	-	-	175,0	
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-Sta.	Jahr 2016	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	
EU-Institutionen	Jahr 2016	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	
Übrige Staaten/Ins	Jahr 2016	-	-	-	-	
	Jahr 2015	-	-	-	-	

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

4. Quartal 2016

	4. Quartal	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	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - al	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	55,0	-	55,0	55,0
Deutschland	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	30,0	-	30,0	30,0
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	25,0	-	25,0	25,0
Schweiz	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
Japan	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
USA	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
Sonstige OECD-Sta	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-
Übrige Staaten/Ins	Jahr 2016	-	-	-	-
	Jahr 2015	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

4. Quartal 2016

Hypothekendarlehen

		Q4 2016	Q4 2015
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	1.746,0	2.208,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	98,88	94,59
Deckungsmasse			
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	%	42,72	44,69
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	875,5	621,2
	USD	-	-
...	-	-	
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 1 Nr. 11	Jahre	4,6	4,8
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	47,60	48,70
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-

Öffentliche Pfandbriefe

		Q4 2016	Q4 2015
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	1.202,4	1.881,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,00	100,00
Deckungsmasse			
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	%	80,50	84,36
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	-	-
...	-	-	

Angaben im Jahresabschluß (Anhang) gem. § 28 Abs.2 Nr.3 PfandBG



	Jahr 2016		Jahr 2015	
	gewerblich Anzahl	wohnwirtschaftlich Anzahl	gewerblich Anzahl	wohnwirtschaftlich Anzahl
a)				
anhängige Zwangsversteigerungen	0	0	0	0
anhängige Zwangsverwaltungen	0	0	0	0
davon in anhängige Zwangsversteigerungen enthalten	(0)	(0)	(0)	(0)
durchgeführte Zwangsversteigerungen	0	0	0	0
b)				
Fälle, in denen zur Verhütung von Verlusten				
Grundstücke übernommen wurden	0	0	0	0
c)				
Gesamtbetrag der Rückstände von Hypothekenschuldnern				
auf zu leistende Zinsen*	41	0	79	2

* Angaben in Tsd. €