

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
3. Quartal 2015

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2015	Q3 2014	Q3 2015	Q3 2014	Q3 2015	Q3 2014
Hypothekepfandbriefe	(Mio. C)	13.190,0	17.943,0	14.880,0	20.322,0	14.454,0	20.618,0
darunter Derivate	(Mio. C)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. C)	15.396,0	19.829,0	16.589,0	21.246,0	16.107,0	21.335,0
darunter Derivate	(Mio. C)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. C)	2.206,0	1.886,0	1.709,0	924,0	1.653,0	717,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		16,7	10,5	11,5	4,5	11,4	3,5
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. C)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2015	Q3 2014	Q3 2015	Q3 2014	Q3 2015	Q3 2014
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. C)	12.359,0	15.958,0	15.416,0	19.427,0	14.103,0	20.376,0
darunter Derivate	(Mio. C)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. C)	12.956,0	16.362,0	16.304,0	20.493,0	14.515,0	21.556,0
darunter Derivate	(Mio. C)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. C)	597,0	404,0	888,0	1.066,0	412,0	1.180,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,8	2,5	5,8	5,5	2,9	5,8
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. C)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
3. Quartal 2015

Hypothekendarfandbriefe	Q3 2015		Q3 2014	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	3.225,0	4.308,0	1.383,0	5.245,0
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	2.106,0	1.393,0	1.619,0	1.602,0
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	234,0	1.172,0	3.429,0	2.447,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	858,0	928,0	2.225,0	1.402,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.398,0	2.060,0	1.612,0	2.637,0
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	2.506,0	1.456,0	2.130,0	1.994,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	205,0	973,0	2.593,0	1.468,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.817,0	2.478,0	1.751,0	2.402,0
> 10 Jahre	841,0	628,0	1.201,0	632,0

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2015		Q3 2014	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	442,0	2.914,0	1.158,0	3.841,0
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.035,0	684,0	637,0	740,0
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.934,0	337,0	464,0	387,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	473,0	404,0	1.248,0	579,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	649,0	572,0	2.698,0	713,0
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	872,0	500,0	831,0	647,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.032,0	669,0	899,0	621,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.121,0	2.404,0	2.812,0	3.578,0
> 10 Jahre	3.801,0	4.471,0	5.210,0	5.256,0

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

3. Quartal 2015

Deckungswerte	Q3 2015 Mio. €	Q3 2014 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	6.359,0	6.827,0
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	858,0	853,0
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	1.915,0	2.997,0
Mehr als 10 Mio. €	4.191,0	7.447,0
Summe	13.323,0	18.124,0

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

3. Quartal 2015

Deckungswerte	Q3 2015 Mio. €	Q3 2014 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	698,0	-
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	3.208,0	-
Mehr als 100 Mio. €	8.898,0	-
Summe	12.804,0	-

Hinweis: Die Größengruppen von Öffentlichen Darlehen werden erst ab Q2 2015 erfasst.

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.

3. Quartal 2015

Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt	
Insgesamt	davon	Wohnwirtschaftlich						Gewerblich										
		Insgesamt	davon					Insgesamt	davon									
			Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- 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				
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten		Jahr 2015	13.323,0	7.830,0	1.493,0	4.234,0	2.085,0	18,0	-	5.493,0	1.606,0	3.092,0	208,0	378,0	209,0	-	35,5	39,6
		Jahr 2014	18.125,0	8.628,0	1.544,0	4.396,0	2.666,0	21,0	1,0	9.497,0	3.450,0	4.545,0	483,0	727,0	267,0	25,0	27,6	36,6
Deutschland		Jahr 2015	11.099,0	7.827,0	1.490,0	4.234,0	2.085,0	18,0	-	3.272,0	975,0	1.593,0	187,0	309,0	208,0	-	26,0	30,3
		Jahr 2014	13.791,0	8.625,0	1.541,0	4.396,0	2.666,0	21,0	1,0	5.166,0	1.723,0	2.312,0	288,0	554,0	264,0	25,0	10,4	17,4
Belgien		Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	31,0	-	-	-	-	-	-	31,0	9,0	18,0	-	4,0	-	-	-	-
Dänemark		Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	15,0	-	-	-	-	-	-	15,0	2,0	-	13,0	-	-	-	-	-
Finnland		Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	67,0	-	-	-	-	-	-	67,0	36,0	28,0	3,0	-	-	-	8,8	8,8
Frankreich		Jahr 2015	739,0	3,0	3,0	-	-	-	-	736,0	317,0	400,0	6,0	13,0	-	-	9,3	9,3
		Jahr 2014	1.089,0	3,0	3,0	-	-	-	-	1.086,0	615,0	401,0	54,0	13,0	3,0	-	0,1	-
Griechenland		Jahr 2015	31,0	-	-	-	-	-	-	31,0	-	31,0	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien		Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	20,0	-	-	-	-	-	-	20,0	20,0	-	-	-	-	-	-	-
Italien		Jahr 2015	226,0	-	-	-	-	-	-	226,0	73,0	121,0	-	31,0	1,0	-	0,2	-
		Jahr 2014	522,0	-	-	-	-	-	-	522,0	89,0	400,0	-	33,0	-	-	0,1	-
Luxemburg		Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	185,0	-	-	-	-	-	-	185,0	185,0	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande		Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	275,0	-	-	-	-	-	-	275,0	135,0	-	94,0	46,0	-	-	7,4	7,4
Österreich		Jahr 2015	5,0	-	-	-	-	-	-	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2014	123,0	-	-	-	-	-	-	123,0	91,0	29,0	-	3,0	-	-	-	-

Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	3. Quartal	Mio. €	davon						davon								
			Insgesamt	Wohnwirtschaftlich					Insgesamt	Gewerblich							
				Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- 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. €		
Polen	Jahr 2015	358,0	-	-	-	-	-	-	358,0	81,0	277,0	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	418,0	-	-	-	-	-	-	418,0	74,0	344,0	-	-	-	-	-	
Portugal	Jahr 2015	830,0	-	-	-	-	-	-	830,0	125,0	665,0	15,0	25,0	-	-	-	
	Jahr 2014	943,0	-	-	-	-	-	-	943,0	208,0	689,0	17,0	29,0	-	-	-	
Rumänien	Jahr 2015	19,0	-	-	-	-	-	-	19,0	19,0	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	69,0	-	-	-	-	-	-	69,0	19,0	45,0	5,0	-	-	-	-	
Schweden	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	3,0	-	-	-	-	-	-	3,0	-	3,0	-	-	-	-	0,3	
Slowakei	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	32,0	-	-	-	-	-	-	32,0	19,0	6,0	7,0	-	-	-	-	
Tschechien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	165,0	-	-	-	-	-	-	165,0	70,0	95,0	-	-	-	-	-	
Ungarn	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	179,0	-	-	-	-	-	-	179,0	60,0	87,0	-	32,0	-	-	-	
Zypern	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	62,0	-	-	-	-	-	-	62,0	-	62,0	-	-	-	-	-	
Island	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	37,0	-	-	-	-	-	-	37,0	11,0	26,0	-	-	-	-	0,5	
Schweiz	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	85,0	-	-	-	-	-	-	85,0	70,0	-	2,0	13,0	-	-	-	
USA	Jahr 2015	16,0	-	-	-	-	-	-	16,0	16,0	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2014	14,0	-	-	-	-	-	-	14,0	14,0	-	-	-	-	-	-	

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen
3. Quartal 2015

		Deckungswerte					
		Summe		davon			
			in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2015	12.804,2	-	2.951,0	6.691,8	2.205,2	956,2
	Jahr 2014	15.726,2	-	3.982,2	8.276,4	2.402,8	1.064,8
Deutschland	Jahr 2015	6.693,4	-	1.067,1	4.068,0	1.135,1	423,2
	Jahr 2014	8.958,2	-	1.179,6	5.971,8	1.332,3	474,5
Belgien	Jahr 2015	35,0	-	-	35,0	-	-
	Jahr 2014	65,0	-	-	65,0	-	-
Dänemark	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	4,8	-	-	4,8	-	-
Estland	Jahr 2015	9,7	-	-	-	9,7	-
	Jahr 2014	11,0	-	-	-	11,0	-
Finnland	Jahr 2015	95,1	-	-	-	95,1	-
	Jahr 2014	100,0	-	-	-	100,0	-
Frankreich	Jahr 2015	446,4	-	-	-	5,0	441,4
	Jahr 2014	519,9	-	-	-	19,9	500,0
Großbritannien	Jahr 2015	521,8	-	513,0	-	8,8	-
	Jahr 2014	569,1	-	560,7	-	8,4	-
Italien	Jahr 2015	594,2	-	43,6	485,4	65,2	-
	Jahr 2014	486,6	-	41,5	379,1	66,0	-
Litauen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	68,0	-	68,0	-	-	-
Niederlande	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	2,3	-	-	-	2,3	-
Österreich	Jahr 2015	1.597,9	-	622,3	973,0	2,6	-
	Jahr 2014	1.196,3	-	677,3	513,0	6,0	-
Polen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	452,8	-	452,8	-	-	-
Portugal	Jahr 2015	326,1	-	326,1	-	-	-
	Jahr 2014	326,1	-	326,1	-	-	-
Schweden	Jahr 2015	21,3	-	-	-	21,3	-
	Jahr 2014	21,9	-	-	-	21,9	-
Slowakei	Jahr 2015	50,0	-	-	50,0	-	-
	Jahr 2014	150,0	-	100,0	50,0	-	-
Slowenien	Jahr 2015	1,9	-	1,9	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2015	184,8	-	-	184,8	-	-
	Jahr 2014	196,6	-	-	196,6	-	-
Tschechien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	54,5	-	54,5	-	-	-
Ungarn	Jahr 2015	332,4	-	332,4	-	-	-
	Jahr 2014	380,0	-	330,0	50,0	-	-
Island	Jahr 2015	77,9	-	44,6	-	33,3	-
	Jahr 2014	220,5	-	184,5	-	36,0	-
Schweiz	Jahr 2015	877,2	-	-	702,2	175,0	-
	Jahr 2014	810,8	-	-	652,5	158,3	-
Japan	Jahr 2015	104,6	-	-	75,4	29,2	-
	Jahr 2014	111,2	-	7,2	74,6	29,4	-
Kanada	Jahr 2015	178,6	-	-	118,0	36,6	24,0
	Jahr 2014	235,6	-	-	175,1	39,1	21,4
USA	Jahr 2015	606,3	-	-	-	588,3	18,0
	Jahr 2014	635,9	-	-	47,7	572,2	16,0
EU-Institutionen	Jahr 2015	49,6	-	-	-	-	49,6
	Jahr 2014	96,4	-	-	43,5	-	52,9
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	52,7	-	-	52,7	-	-

Hinweis: Die Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung werden erst ab Q2 2015 erfasst.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
3. Quartal 2015**

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Dänemark	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Estland	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Litauen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowakei	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Tschechien	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ungarn	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Island	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung
3. Quartal 2015

Weitere Deckungswerte für Hypothekenpfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr.1, Nr. 2 und 3						
Staat	3. Quartal	Summe Mio. €	davon		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2 Insgesamt Mio. €	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3 Mio. €
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1 Mio. €	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2015	2.073,2	-	-	1.390,0	683,2
	Jahr 2014	1.705,0	-	-	1.305,0	400,0
Deutschland	Jahr 2015	1.195,0	-	-	1.195,0	-
	Jahr 2014	1.175,0	-	-	775,0	400,0
Niederlande	Jahr 2015	100,0	-	-	100,0	-
	Jahr 2014	100,0	-	-	100,0	-
Österreich	Jahr 2015	245,0	-	-	-	245,0
	Jahr 2014	230,0	-	-	230,0	-
Norwegen	Jahr 2015	95,0	-	-	95,0	-
	Jahr 2014	50,0	-	-	50,0	-
Kanada	Jahr 2015	86,3	-	-	-	86,3
	Jahr 2014	150,0	-	-	150,0	-
USA	Jahr 2015	351,9	-	-	-	351,9
	Jahr 2014	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung
3. Quartal 2015

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2					
Staat	3. Quartal	Summe Mio. €	davon		
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1 Mio. €	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2	
				Insgesamt Mio. €	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2015	151,3	-	151,3	-
	Jahr 2014	635,6	-	635,6	635,6
Deutschland	Jahr 2015	151,3	-	151,3	-
	Jahr 2014	533,9	-	533,9	533,9
Kanada	Jahr 2015	-	-	-	-
	Jahr 2014	101,7	-	101,7	101,7

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 7, 8, 9, 10 und 11 PfandBG und § 28 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
3. Quartal 2015

Hypothekendarlehen			Q3 2015	Q3 2014
Umlaufende Pfandbriefe				
	(Mio. €)		13.190,0	17.943,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%		97,20	95,60
§ 28 Abs. 1 Nr. 9				
Deckungsmasse				
	(Mio. €)		15.396,0	19.829,0
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten	(Mio. €)		-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 7				
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 liegen	(Mio. €)		-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 8				
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 liegen	(Mio. €)		-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 8				
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%		68,70	59,80
§ 28 Abs. 1 Nr. 9				
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro	CAD		-	-
	CHF		67,3	234,9
	CZK		-	18,4
	DKK		-	15,2
	GBP		-	11,1
	HKD		-	-
	JPY		-	-
	NOK		-	-
	SEK		-	3,2
	USD		395,0	15,3
AUD		-	-	
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)		Jahre	11,5	10,7
§ 28 Abs. 1 Nr. 11				
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	%		50,90	44,10
§ 28 Abs. 2 Nr. 3 *				
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis	%		-	-
- freiwillige Angabe -				

*Änderung der Berechnungsmethodik durch Anpassung PfandBG erstmals für das Q 2 2015

Öffentliche Pfandbriefe

		Q3 2015	Q3 2014
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	12.359,0	15.958,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	88,60	85,70
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.956,0	16.362,0
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 20 Abs. 2 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	79,20	80,00
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	57,9	61,2
	CHF	355,5	322,9
	CZK	-	66,0
	DKK	-	5,3
	GBP	1.141,5	706,6
	HKD	-	-
	JPY	70,7	77,0
	NOK	-6,2	-12,3
	SEK	21,2	21,9
	USD	784,0	1.061,3
AUD	-148,1	-115,5	