

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)	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	490,00	345,00	507,74	359,93	426,41	301,87	607,88	376,61
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	643,14	459,91	704,32	508,19	612,93	442,88	817,74	525,96
davon gattungsklassische Deckungswerte	603,64	433,91	664,54	481,21	581,55	419,23	766,79	498,11
davon weitere Deckungswerte	39,50	26,00	39,78	26,97	31,38	23,65	50,94	27,85
Überdeckung in %	31,25%	33,31%	38,72%	41,19%	43,74%	46,71%	34,52%	39,66%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,83%	7,49%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
bis zu 6 Monate	34,88	17,34	-	-	34,88	17,34
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	18,04	9,74	-	-	18,04	9,74
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	14,05	11,40	-	-	14,05	11,40
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	15,03	22,13	-	-	15,03	22,13
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	60,66	19,98	-	-	60,66	19,98
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	60,17	53,87	40,00	-	20,17	53,87
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	63,24	52,52	45,00	40,00	18,24	12,52
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	277,44	214,86	405,00	305,00	-127,56	-90,14
über 10 Jahre	99,63	58,06	-	-	99,63	58,06

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statisches Verfahren gem. PfandBarwertV

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

Weitere Deckung nach	30.06.2018				30.06.2017				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
§19 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG	-	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung *)	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		§19 Abs.1 Nr.3 PfandBG 20%-Grenze		Summe	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	33,50	10,00	33,50	10,00
Osterreich	-	-	-	-	6,00	6,00	6,00	6,00
EU-Institutionen	-	-	-	-	-	10,00	-	10,00
Summe	-	-	-	-	39,50	26,00	39,50	26,00

*) Die Tabelle enthält Nominalwerte der weiteren Deckungswerte inklusive der sichernden Überdeckung und der Liquiditätssicherung.

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
keine	-	-	-	-	-	-

	30.06.2018	30.06.2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,67%	97,57%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,29%	55,16%
Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,55	4,51

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.06.2018		30.06.2017		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017	

nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	414,45	303,88
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	71,58	39,73
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	107,02	79,70
mehr als 10 Mio.€	10,60	10,60

nach Nutzungsart (I) in Deutschland		
wohnwirtschaftlich	483,55	344,93
gewerblich	120,09	88,98

nach Nutzungsart (II) in Deutschland			
Eigentumswohnungen	118,45	95,65	18,42%
Ein- und Zweifamilienhäuser	292,90	200,36	45,54%
Mehrfamilienhäuser	72,20	48,91	11,23%
Bürogebäude	26,14	18,98	4,06%
Handelsgebäude	4,62	4,62	0,72%
Industriegebäude	68,11	41,00	10,59%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	21,22	24,37	3,30%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%
Bauplätze	-	-	0,00%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)			
weitere Deckungswerte	39,50	26,00	8,06%
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	39,50	26,00	8,06%
davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%
davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	39,50	26,00	8,06%
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	39,50	26,00	8,06%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	643,14	459,91	131,25%

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 2 Nr. 2 (Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	30.06.2018	30.06.2017	30.06.2018	30.06.2017
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-