

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)	
	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	260,00	185,00	286,72	198,99	238,89	165,11	291,50	213,55
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	362,05	263,42	414,16	293,66	360,85	256,42	418,77	307,59
davon gattungsklassische Deckungswerte	342,05	243,42	392,57	272,68	341,89	238,38	397,00	285,46
davon weitere Deckungswerte	20,00	20,00	21,59	20,98	18,96	18,04	21,76	22,12
Überdeckung in %	39,25%	42,39%	44,45%	47,57%	51,05%	55,31%	43,66%	44,03%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,53%	10,54%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015
bis zu 6 Monate	20,34	10,44	-	-	20,34	10,44
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	7,20	7,91	-	-	7,20	7,91
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	8,86	9,66	-	-	8,86	9,66
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	9,72	5,80	-	-	9,72	5,80
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	30,46	15,26	-	-	30,46	15,26
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	14,58	23,49	-	-	14,58	23,49
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	50,64	10,59	-	-	50,64	10,59
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	182,78	157,79	260,00	185,00	-	-
über 10 Jahre	37,47	22,47	-	-	37,47	22,47

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	30.06.2016				30.06.2015				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	
	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
Luxemburg	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
Summe	-	-	-	-	20,00	20,00	20,00	20,00

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

Nettobarwert je Fremdwahrung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwahrung	
	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015
keine	-	-	-	-	-	-

	30.06.2016	30.06.2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,15%	97,32%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,71%	54,48%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,17	3,94

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.06.2016		30.06.2015		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.06.2016		30.06.2015		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs

nach Größenklassen	30.06.2016	30.06.2015
bis einschließlich 300 T€	234,00	185,52
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	35,08	25,75
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	62,36	32,15
mehr als 10 Mio.€	10,60	-

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	30.06.2016	30.06.2015
wohnwirtschaftlich	261,99	197,30
gewerblich	80,07	46,12

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	30.06.2016	30.06.2015	Anteil
Eigentumswohnungen	74,60	67,36	20,60%
Ein- und Zweifamilienhäuser	149,64	110,23	41,33%
Mehrfamilienhäuser	37,75	19,71	10,43%
Bürogebäude	19,02	9,84	5,25%
Handelsgebäude	4,63	0,07	1,28%
Industriegebäude	41,18	21,38	11,37%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	15,23	14,83	4,21%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%
Bauplätze	-	-	0,00%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

sonstige Deckungswerte	30.06.2016	30.06.2015	Anteil
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-	0,00%
davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%
davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	0,00%
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	20,00	20,00	7,69%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%

Summe gattungsklassische und weitere Deckung	362,05	263,42	139,25%
----------------------------------------------	--------	--------	---------

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

Lander	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	30.06.2016	30.06.2015	30.06.2016	30.06.2015
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-