

**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)	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	325,00	230,00	342,57	254,10	286,66	211,98	355,59	260,15
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	423,78	303,99	471,07	345,76	410,35	302,90	484,39	350,72
davon gattungsklassische Deckungswerte	397,78	283,99	443,98	324,31	386,75	284,18	456,54	328,95
davon weitere Deckungswerte	26,00	20,00	27,08	21,45	23,59	18,72	27,85	21,76
Überdeckung in %	30,39%	32,17%	37,51%	36,07%	43,15%	42,89%	36,22%	34,81%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,91%	8,44%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
bis zu 6 Monate	17,55	10,97	-	-	17,55	10,97
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	9,46	13,14	-	-	9,46	13,14
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	8,89	7,28	-	-	8,89	7,28
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	21,21	7,51	-	-	21,21	7,51
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	19,48	27,70	-	-	19,48	27,70
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	44,31	14,31	-	-	44,31	14,31
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	50,51	39,40	30,00	-	20,51	39,40
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	202,39	160,25	295,00	230,00	-92,61	-69,75
über 10 Jahre	49,98	23,43	-	-	49,98	23,43

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	31.03.2017				31.03.2016				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	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
Osterreich	-	-	-	-	6,00	0,00	6,00	-
EU-Institutionen	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
<b>Summe</b>	-	-	-	-	<b>26,00</b>	<b>20,00</b>	<b>26,00</b>	<b>20,00</b>

\*) 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	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
keine	-	-	-	-	-	-

	31.03.2017	31.03.2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,43%	96,85%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,00%	54,52%
Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,37	4,16

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	31.03.2017		31.03.2016		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016	

nach Größenklassen	31.03.2017	31.03.2016
bis einschließlich 300 T€	282,99	208,58
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	37,47	31,31
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	66,72	44,10
mehr als 10 Mio.€	10,60	-

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	31.03.2017	31.03.2016
wohnwirtschaftlich	319,51	226,58
gewerblich	78,27	57,40

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	31.03.2017	31.03.2016	Anteil
Eigentumswohnungen	90,07	68,29	21,25%
Ein- und Zweifamilienhäuser	183,61	129,53	43,33%
Mehrfamilienhäuser	45,83	28,77	10,81%
Bürogebäude	18,99	15,86	4,48%
Handelsgebäude	4,62	-	1,09%
Industriegebäude	37,85	27,35	8,93%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	16,80	14,20	3,97%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%
Bauplätze	-	-	0,00%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

weitere Deckungswerte	31.03.2017	31.03.2016	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	26,00	20,00	8,00%
davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	-
davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	-
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	26,00	20,00	8,00%
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	26,00	20,00	8,00%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	-
<b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>	<b>423,78</b>	<b>303,99</b>	<b>130,39%</b>

**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	
	31.03.2017	31.03.2016	31.03.2017	31.03.2016
keine	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-