

**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)	
	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	410,00	295,00	424,91	316,32	356,72	264,70	444,59	325,63
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	542,42	407,05	595,99	456,94	521,61	398,30	616,19	466,86
davon gattungsklassische Deckungswerte	512,92	381,05	565,61	429,51	494,95	374,52	584,83	438,76
davon weitere Deckungswerte	29,50	26,00	30,38	27,43	26,66	23,77	31,37	28,10
Überdeckung in %	32,30%	37,98%	40,26%	44,45%	46,23%	50,47%	38,60%	43,37%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,15%	8,67%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016
bis zu 6 Monate	27,62	14,39	-	-	27,62	14,39
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	13,70	15,31	-	-	13,70	15,31
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	23,50	10,05	-	-	23,50	10,05
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	12,06	9,91	-	-	12,06	9,91
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	34,02	30,88	-	-	34,02	30,88
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	63,46	23,04	20,00	-	43,46	23,04
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	60,04	59,94	40,00	20,00	20,04	39,94
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	238,86	198,40	350,00	275,00	111,14	-76,60
über 10 Jahre	69,16	45,14	-	-	69,16	45,14

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	31.12.2017				31.12.2016				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	
	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	13,50	10,00	13,50	10,00
Osterreich	-	-	-	-	6,00	6,00	6,00	6,00
EU-Institutionen	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
<b>Summe</b>	-	-	-	-	<b>29,50</b>	<b>26,00</b>	<b>29,50</b>	<b>26,00</b>

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

Nettoarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmasse		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettoarwert in Fremdwährung	
	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016
keine	-	-	-	-	-	-

	31.12.2017	31.12.2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,70%	97,23%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,29%	55,25%
Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,78	4,36

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	31.12.2017		31.12.2016		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	31.12.2017		31.12.2016		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen											
bis einschließlich 300 T€	359,22	264,74				29,50	26,00	7,20%			
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	52,32	36,48						0,00%			
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	90,78	69,23						0,00%			
mehr als 10 Mio.€	10,60	10,60						0,00%			
nach Nutzungsart (I) in Deutschland											
wohnwirtschaftlich	415,65	301,16				29,50	26,00	7,20%			
gewerblich	97,27	79,89						0,00%			
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	106,19	83,83	19,58%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	249,22	170,25	45,95%								
Mehrfamilienhäuser	60,25	47,08	11,11%								
Bürogebäude	19,85	19,00	3,66%								
Handelsgebäude	4,62	4,62	0,85%								
Industriegebäude	43,28	38,54	7,98%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	29,51	17,73	5,44%								
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%								
Bauplätze	-	-	0,00%								
<b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>	<b>542,42</b>	<b>407,05</b>	<b>132,30%</b>								

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

**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	
	31.12.2017	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2016
keine	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-