

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)	
	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	185,00	135,00	198,99	146,17	165,11	120,14	213,55	160,98
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	263,42	177,24	293,66	198,62	256,42	174,05	307,59	209,93
davon gattungsklassische Deckungswerte	243,42	167,24	272,68	187,67	238,38	164,25	285,46	198,68
davon weitere Deckungswerte	20,00	10,00	20,98	10,95	18,04	9,80	22,12	11,25
Überdeckung in %	42,39%	31,29%	47,57%	35,89%	55,31%	44,87%	44,03%	30,41%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,54%	7,49%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014
bis zu 6 Monate	10,44	7,51	-	-	10,44	7,51
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	7,91	4,12	-	-	7,91	4,12
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	9,66	5,10	-	-	9,66	5,10
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	5,80	12,19	-	-	5,80	12,19
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	15,26	8,67	-	-	15,26	8,67
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	23,49	10,17	-	-	23,49	10,17
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	10,59	18,44	-	-	10,59	18,44
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	157,79	101,12	185,00	135,00	-27,21	-33,88
über 10 Jahre	22,47	9,92	-	-	22,47	9,92

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	30.06.2015				30.06.2014				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	
	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	10,00	-	10,00	-
Luxemburg	-	10,00	-	-	10,00	-	10,00	10,00
Summe	-	10,00	-	-	20,00	-	20,00	10,00

*) Die Tabelle enthält Nominalwerte der weiteren Deckungswerte inklusive der sichernden Überdeckung; Ausweis entsprechend der Übergangsvorschrift nach § 54 Pfand BG

Nettoarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettoarwert in Fremdwährung	
	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014
keine	-	-	-	-	-	-

	30.06.2015	30.06.2014
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,32%	99,02%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,48%	48,90%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigerverrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	3,94	3,70

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.06.2015		30.06.2014		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.06.2015		30.06.2014		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen											
bis einschließlich 300 T€	185,52	135,58									
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	25,75	17,05									
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	32,15	14,61									
mehr als 10 Mio.€	-	-									
nach Nutzungsart (I) in Deutschland											
wohnwirtschaftlich	197,30	141,41									
gewerblich	46,12	25,83									
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	67,36	59,41	25,57%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	110,23	69,67	41,85%								
Mehrfamilienhäuser	19,71	12,33	7,48%								
Bürogebäude	9,84	1,81	3,74%								
Handelsgebäude	0,07	0,22	0,02%								
Industriegebäude	21,38	11,84	8,12%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	14,83	11,96	5,63%								
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%								
Bauplätze	-	-	0,00%								
Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.											
sonstige Deckungswerte						20,00	10,00	10,81%			
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. Kl.						-	-	0,00%			
Gesamtaustlastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG						-	-	0,00%			
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)						20,00	10,00	10,81%			
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG						-	-	0,00%			
Summe gattungsklassische und weitere Deckung						263,42	177,24	142,39%			

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	
	30.06.2015	30.06.2014	30.06.2015	30.06.2014
keine	-	0,00	-	0,00
Summe	-	0,00	-	0,00