

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)	
	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	155,00	95,00	170,16	98,09	139,92	80,14	183,14	114,53
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	205,15	135,91	232,35	150,86	203,47	130,37	242,10	166,84
davon gattungsklassische Deckungswerte	195,15	125,91	221,27	140,10	193,50	120,90	230,85	155,34
davon sonstige Deckungswerte	10,00	10,00	11,07	10,76	9,97	9,47	11,25	11,50
Überdeckung in %	32,36%	43,06%	36,54%	53,80%	45,42%	62,67%	32,19%	45,67%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			6,51%	10,97%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013
bis zu 6 Monate	8,93	5,30	-	-	8,93	5,30
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	3,23	-	-	-	3,23	-
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	14,16	-	-	-	14,16	-
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	4,47	5,77	-	-	4,47	5,77
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	10,73	7,08	-	-	10,73	7,08
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	11,98	6,72	-	-	11,98	6,72
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	18,67	7,83	-	-	18,67	7,83
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	120,78	95,99	155,00	95,00	-34,22	0,99
über 10 Jahre	12,21	7,22	-	-	12,21	7,22

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	30.09.2014				30.09.2013			
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	-	-	-	-	-	-	-	-

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. 575/2012		§19 Abs.1 Nr 3 PfandBG 20%-Grenze		Summe	
	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	10,00	10,00	-	-	-	-	10,00	10,00
Summe	10,00	10,00	-	-	-	-	10,00	10,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013
keine	-	-	-	-	-	-

	30.09.2014	30.09.2013
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,16%	n.v.
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	n.v.
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	49,16%	n.v.
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	n.v.
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	3,69	n.v.

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.09.2014		30.09.2013		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.09.2014		30.09.2013		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen							10,00	10,00		6,45%	
bis einschließlich 300 T€	144,12	108,89								0,00%	
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	21,46									0,00%	
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	29,58	17,01								0,00%	
mehr als 10 Mio.€	-	-								0,00%	
nach Nutzungsart (I) in Deutschland							10,00	10,00		6,45%	
wirtschaftlich	150,72	116,24								0,00%	
gewerblich	44,44	9,66								0,00%	
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	61,80	48,99			30,12%						
Ein- und Zweifamilienhäuser	74,69	67,25			36,41%						
Mehrfamilienhäuser	14,23				6,94%						
Bürogebäude	9,74	0,54			4,75%						
Handelsgebäude	0,21	0,36			0,10%						
Industriegebäude	21,68	2,24			10,57%						
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	12,80	6,52			6,24%						
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-			0,00%						
Bauplätze	-	-			0,00%						
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	205,15	135,91			132,36%						

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 3 Nr. 2 (Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	30.09.2014	30.09.2013	30.09.2014	30.09.2013
keine	0,00	-	0,00	n.v.
Summe	0,00	-	0,00	n.v.