

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)	
	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	295,00	210,00	324,08	227,24	269,70	188,44	326,80	240,40
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	394,46	270,80	451,87	304,27	393,59	265,91	454,29	315,24
davon gattungsklassische Deckungswerte	374,46	250,80	430,14	283,00	374,39	247,51	432,53	293,11
davon weitere Deckungswerte	20,00	20,00	21,73	21,27	19,20	18,40	21,76	22,12
Überdeckung in %	33,71%	28,95%	39,43%	33,90%	45,94%	41,11%	39,01%	31,13%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,70%	9,36%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015
bis zu 6 Monate	16,92	11,23	-	-	16,92	11,23
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	10,91	6,04	-	-	10,91	6,04
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	13,70	9,72	-	-	13,70	9,72
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	8,56	6,94	-	-	8,56	6,94
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	32,16	15,89	-	-	32,16	15,89
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	16,66	22,91	-	-	16,66	22,91
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	59,80	12,16	10,00	-	49,80	12,16
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	191,90	163,21	285,00	210,00	93,10	-46,79
über 10 Jahre	43,86	22,70	-	-	43,86	22,70

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	30.09.2016				30.09.2015				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	
	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015
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 Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015
keine	-	-	-	-	-	-

	30.09.2016	30.09.2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,22%	97,30%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,20%	54,32%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigerverrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,22	4,05

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.09.2016		30.09.2015		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.09.2016		30.09.2015		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen							20,00	20,00	6,78%		
bis einschließlich 300 T€	256,56	187,98				weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-	0,00%		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	36,54	27,88				davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%		
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	70,76	34,94				davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%		
mehr als 10 Mio.€	10,60	-				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	0,00%		
nach Nutzungsart (I) in Deutschland						Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	20,00	20,00	6,78%		
wohnwirtschaftlich	292,19	201,35				Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%		
gewerblich	82,27	49,45				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	394,46	270,80	133,71%		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	82,02	67,07	20,79%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	163,04	113,27	41,33%								
Mehrfamilienhäuser	47,13	21,02	11,95%								
Bürogebäude	19,01	9,83	4,82%								
Handelsgebäude	4,62	-	1,17%								
Industriegebäude	42,04	25,29	10,66%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	16,59	14,32	4,20%								
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%								
Bauplätze	-	-	0,00%								

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	
	30.09.2016	30.09.2015	30.09.2016	30.09.2015
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-