

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)	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	380,00	295,00	395,10	324,08	331,25	269,70	413,21	326,80
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	490,88	394,46	542,72	451,87	473,90	393,59	560,76	454,29
davon gattungsklassische Deckungswerte	464,88	374,46	515,66	430,14	450,03	374,39	532,92	432,53
davon weitere Deckungswerte	26,00	20,00	27,06	21,73	23,87	19,20	27,85	21,76
Überdeckung in %	29,18%	33,71%	37,36%	39,43%	43,06%	45,94%	35,71%	39,01%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,85%	6,70%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
bis zu 6 Monate	15,39	16,92	-	-	15,39	16,92
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	13,40	10,91	-	-	13,40	10,91
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	23,20	13,70	-	-	23,20	13,70
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	12,31	8,56	-	-	12,31	8,56
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	21,77	32,16	-	-	21,77	32,16
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	64,46	16,66	10,00	-	54,46	16,66
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	50,36	59,80	40,00	10,00	10,36	49,80
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	229,93	191,90	330,00	285,00	100,07	-93,10
über 10 Jahre	60,07	43,86	-	-	60,07	43,86

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	30.09.2017				30.09.2016				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	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
Osterreich	-	-	-	-	6,00	-	6,00	-
EU-Institutionen	-	-	-	-	10,00	10,00	10,00	10,00
Summe	-	-	-	-	26,00	20,00	26,00	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	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
keine	-	-	-	-	-	-

	30.09.2017	30.09.2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,51%	97,22%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,23%	55,20%
Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,65	4,22

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.09.2017		30.09.2016		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	30.09.2017		30.09.2016		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen											
bis einschließlich 300 T€	329,32	256,56				26,00	20,00	6,84%			
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	41,05	36,54				-	-	0,00%			
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	83,91	70,76				-	-	0,00%			
mehr als 10 Mio.€	10,60	10,60				-	-	0,00%			
nach Nutzungsart (I) in Deutschland											
wohnwirtschaftlich	371,82	292,19				26,00	20,00	6,84%			
gewerblich	93,06	82,27				-	-	0,00%			
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	99,69	82,02	20,31%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	222,02	163,04	45,23%								
Mehrfamilienhäuser	50,11	47,13	10,21%								
Bürogebäude	19,35	19,01	3,94%								
Handelsgebäude	4,62	4,62	0,94%								
Industriegebäude	41,55	42,04	8,46%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	27,54	16,59	5,61%								
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%								
Bauplätze	-	-	0,00%								
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	490,88	394,46	129,18%								

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	
	30.09.2017	30.09.2016	30.09.2017	30.09.2016
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-