



Stichtag: 31.03.2016

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) | |
|---|----------|---------|---------|---------|--|---------|---|---------|
| | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 25,00 | 20,00 | 29,34 | 24,63 | 25,81 | 21,18 | 29,91 | 25,41 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 102,12 | 108,53 | 109,90 | 117,22 | 103,93 | 110,45 | 110,00 | 118,07 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 97,12 | 103,53 | 104,79 | 112,13 | 99,33 | 105,41 | 104,90 | 112,98 |
| davon weitere Deckungswerte | 5,00 | 5,00 | 5,11 | 5,09 | 4,60 | 5,04 | 5,10 | 5,09 |
| Überdeckung in % | 308,48% | 442,67% | 274,59% | 375,88% | 302,63% | 421,50% | 267,77% | 364,68% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 17,41% | | | | | |

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

(in Mio. Euro)

| | Laufzeitstruktur I 2016 | | Laufzeitstruktur I 2015 | | Überhang | |
|---|-------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|----------|--------|
| | Deckungs- masse | Pfandbrief- umlauf | Deckungs- masse | Pfandbrief- umlauf | I 2016 | I 2015 |
| bis zu sechs Monate | 50,62 | 0,00 | 56,58 | 0,00 | 50,62 | 56,58 |
| mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monate | 3,02 | 0,00 | 2,23 | 0,00 | 3,02 | 2,23 |
| mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten | 0,91 | 5,00 | 3,22 | 0,00 | -4,09 | 3,22 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 2,42 | 5,00 | 3,02 | 0,00 | -2,58 | 3,02 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 8,10 | 0,00 | 3,33 | 10,00 | 8,10 | -6,67 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 3,32 | 0,00 | 8,10 | 0,00 | 3,32 | 8,10 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 8,25 | 5,00 | 3,32 | 0,00 | 3,25 | 3,32 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 24,22 | 10,00 | 27,45 | 0,00 | 14,22 | 27,45 |
| über 10 Jahre | 1,27 | 0,00 | 1,29 | 10,00 | 1,27 | -8,71 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

| Deckung nach | I 2016 | | | | I 2015 | | | |
|--------------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------|---------------------|
| | Nominalwert brutto | davon nicht anrechenbar | Nominalwert netto | Anteil am Umlauf | Nominalwert brutto | davon nicht anrechenbar | Nominalwert netto | Anteil am Umlauf |
| §20 PfandBG Abs. 2 Nr. 1 | 0,00 | | | 0,00 | 0,00 | | | 0,00 |
| §20 PfandBG Abs. 2 Nr. 2 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung | §20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze | | davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | |
|--|--|-------------|---|-------------|
| | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 |
| keine | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Summe | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| Nettobarwert je Fremdwährung | Barwert der Deckungsmassen | | Barwert des Pfandbriefumlaufs | | Nettobarwert in Fremdwährung | |
|------------------------------|----------------------------|--------|----------------------------------|--------|---------------------------------|--------|
| | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 |
| keine | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | I 2016 | I 2015 |
|---|---------|---------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 64,03% | 64,59% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 100,00% |

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

| | I 2016 | I 2015 |
|--|--------|--------|
| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | 102,12 | 108,53 |

| Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | I 2016 | I 2015 |
|---|--------|--------|
| weitere Deckungen | | |
| nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto | 0,00 | 0,00 |
| höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut | 0,00 | 0,00 |

| Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen | I 2016 | I 2015 |
|---|--------|--------|
| bis zu 10 Millionen € | 23,68 | - |
| mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen € | 78,44 | - |
| mehr als 100 Millionen € | 0,00 | - |

| Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | | Summe | |
|--|--------|--------|---------------------------------|--------|--------------------------------|--------|--------------------|--------|--------|--------|
| | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 | I 2016 | I 2015 |
| Bundesrepublik Deutschland | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 5,00 | 90,00 | 96,23 | 7,12 | 7,30 | 102,12 | 108,53 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine gewährleisteten Forderungen.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 3 Nr. 3 Pfandbriefgesetz

(Angaben in Mio. Euro)

| | I 2016 | I 2015 |
|---|--------|--------|
| Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen | 0,00 | 0,00 |
| Gesamtbetrag der Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag | 0,00 | 0,00 |

| Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige Schuldner | Summe |
|--|-------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------|-------|
| | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige Schuldner | Summe |
|--|-------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------|-------|
| | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |