

| | |
|----------|--------|
| Stichtag | I 2014 |
| Referenz | I 2013 |

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 2014 | I 2013 | I 2014 | I 2013 | I 2014 | I 2013 | I 2014 | I 2013 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 260,00 | 200,00 | 281,28 | 220,64 | 236,32 | 183,29 | 316,89 | 248,46 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmassen | 401,01 | 255,25 | 455,68 | 296,81 | 391,78 | 252,63 | 502,10 | 327,76 |
| davon gattungsklassische | 386,01 | 240,25 | 440,16 | 281,08 | 377,06 | 238,06 | 486,39 | 311,70 |
| davon sonstige Deckungswerte | 15,00 | 15,00 | 15,51 | 15,73 | 14,72 | 14,57 | 15,71 | 16,06 |
| Überdeckung in % | 54,24% | 27,62% | 62,00% | 34,52% | 65,78% | 37,83% | 58,45% | 31,92% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 5,51% | | | | | |

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

(Angaben in Mio. Euro)

| | Laufzeitstruktur I 2014 | | Laufzeitstruktur I 2013 | | Überhang | |
|--|-------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|----------|--------|
| | Deckungs- masse | Pfandbrief- umlauf | Deckungs- masse | Pfandbrief- umlauf | I 2014 | I 2013 |
| bis einschließlich 1 Jahr | 21,49 | 0,00 | 7,39 | 0,00 | 21,49 | 7,39 |
| über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre | 21,28 | 0,00 | 16,69 | 0,00 | 21,28 | 16,69 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 27,75 | 5,00 | 12,01 | 0,00 | 22,75 | 12,01 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 16,08 | 30,00 | 20,02 | 5,00 | -13,92 | 15,02 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 19,09 | 30,00 | 9,18 | 30,00 | -10,91 | -20,82 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 212,36 | 145,00 | 133,93 | 135,00 | 67,36 | -1,07 |
| über 10 Jahre | 82,97 | 50,00 | 56,04 | 30,00 | 32,97 | 26,04 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

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

(Angaben in Mio. Euro)

| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | I 2014 | I 2013 | Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse | Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung) | I 2014 | I 2013 | Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs |
|--|--------|--------|--|--|--------|--------|--|
| nach Größenklassen | | | | sonstige Deckungswerte | 15,00 | 15,00 | 5,77% |
| bis einschließlich 300 T€ | 338,40 | 225,69 | | weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€ | 47,62 | 14,55 | | davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| mehr als 5 Mio.€ | 0,00 | 0,00 | | davon höchste Geldforderung geg. KI | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| nach Nutzungsart (I) in Deutschland | | | | Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| wohnwirtschaftlich | 347,59 | 238,14 | | Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet) | 15,00 | 15,00 | 5,77% |
| gewerblich | 38,42 | 2,11 | | Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| nach Nutzungsart (II) in Deutschland | | | | Summe gattungsklassische und weitere Deckung | 401,01 | 255,25 | 154,24% |
| Wohnungen | 57,27 | 42,12 | 14,28% | | | | |
| Einfamilienhäuser | 223,74 | 158,37 | 55,79% | | | | |
| Mehrfamilienhäuser | 66,54 | 37,64 | 16,59% | | | | |
| Bürogebäude | 5,56 | 0,00 | 1,39% | | | | |
| Handelsgebäude | 3,01 | 0,00 | 0,75% | | | | |
| Industriegebäude | 24,76 | 0,00 | 6,17% | | | | |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 5,13 | 2,11 | 1,28% | | | | |
| unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten | 0,00 | 0,00 | 0,00% | | | | |
| Bauplätze | 0,00 | 0,00 | 0,00% | | | | |

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

| | I 2014 | I 2013 |
|--|--------|--------|
| Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen | 0,00 | 0,00 |