

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	1.184,90	1.493,90	1.300,79	1.650,85	1.248,82	1.610,78	1.352,09	1.687,15
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	3.213,97	3.498,25	3.526,83	3.827,33	3.375,85	3.684,97	3.674,33	3.964,70
davon gattungsklassische	2.997,97	2.846,40	3.293,73	3.155,78	3.151,02	3.023,16	3.432,64	3.283,20
davon sonstige Deckungswerte	216,00	651,85	233,10	671,55	224,83	661,81	241,69	681,49
Überdeckung in %	171,24%	134,17%	171,13%	131,84%	170,32%	128,77%	171,75%	134,99%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			17,92%					

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
≤ 1 Jahr	357,00	168,50	407,16	717,00	188,50	-309,84
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	448,87	45,00	346,52	168,50	403,87	178,02
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	286,67	63,00	859,25	45,00	223,67	814,25
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	297,25	70,00	250,73	10,00	227,25	240,73
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	315,61	444,80	248,38	45,00	-129,19	203,38
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1261,29	375,60	1167,41	508,40	885,69	659,01
> 10 Jahre	247,29	18,00	218,80	0,00	229,29	218,80

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (gattungsklassische Deckung)	I 2014	I 2013
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.636,57	2.526,13
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	328,14	278,58
mehr als 5 Mio.€	33,26	41,69

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	I 2014	I 2013
wohnwirtschaftlich	2.654,34	2.572,53
gewerblich	343,63	273,86

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	I 2014	I 2013	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2014	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2013
Wohnungen	710,14	659,60	22,10%	18,86%
Einfamilienhäuser	1.545,74	1503,93	48,09%	42,99%
Mehrfamilienhäuser	398,47	409,00	12,40%	11,69%
Bürogebäude	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Handelsgebäude	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Industriegebäude	0,00	0,00	0,00%	0,00%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	343,63	273,86	10,69%	7,83%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%	0,00%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	I 2014	I 2013	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2014	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2013
sonstige Deckungswerte	216,00	651,85	18,23%	43,63%
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%	0,00%
davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	216,00	647,10	18,23%	43,32%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	4,75	0,00%	0,32%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	3.213,97	3.498,25	271,24%	234,17%

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

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