

## Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

### I) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG zum Gesamtbetrag (Angaben in Tsd. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten)	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	18.437	19.045	16.842	17.028	18.473	19.057
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	25.498	27.954	29.352	32.832	25.620	28.416	30.462	33.754
davon gattungsklassische Deckungswerte	23.498	25.954	27.153	30.592	23.686	26.487	28.237	31.491
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.199	2.241	1.935	1.928	2.225	2.263
Überdeckung in %	59,36%	74,71%	59,20%	72,39%	52,12%	66,88%	64,90%	77,12%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,93%					

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	148	2.086	0	0	148	2.086
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	41	0	0	0	41	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	201	1.000	0	-1.000	201
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.198	69	0	1.000	2.198	-931
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	8.460	2.269	10.000	0	-1.540	2.269
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.463	8.656	5.000	10.000	-3.537	-1.344
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	6.200	7.367	0	5.000	6.200	2.367
über 10 Jahre	6.988	7.306	0	0	6.988	7.306

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

### III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

Weitere Deckung	Nennwert		Anteil am Pfandbriefumlauf		Überschreitung gesetzlicher Grenzen	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%	0	0
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%		
1. Halbsatz (10,00%)					0	0
2. Halbsatz (2,00%)					0	0

Weitere Deckung nach Ländern und Art der gesetzlichen Begrenzung	§ 20 Abs. 2 Nr. 2 ohne § 4 Abs. 1 Satz 2 Nr. 1 u. 2 PfandBG		davon Forderungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	31.03.17	31.03.16
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	100,00%

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

## Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

### IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 und 2 PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen	31.03.17	31.03.16
bis einschließlich 10 Mio.€	11.291	15.385
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	12.207	12.569
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	-	0	-	23.498	-	0	-

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	-	0	-	0	-	0	-

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	0	0	2.000	23.498	25.954	0	0

	31.03.17	31.03.16
darunter ECA-Finanzierungen	0	0

### V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Tsd. Euro)

Rückständige Leistungen nach Ländern	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16	31.03.17	31.03.16
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

### Erläuterungen zu den im Report verwendeten Begriffen

Gattungsklassische Deckungswerte:	- Darlehnsforderungen oder Schuldverschreibungen nach § 20 Abs. 1 PfandBG
Sonstige Deckungswerte:	- weitere Deckungswerte nach § 20 Abs. 2 Nr. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG - sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG - Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG
Weitere Deckungswerte:	- nach § 20 Abs. 2 Nr. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG
Sichernde Überdeckung:	- nach § 4 Abs. 1 PfandBG