

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)	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	18.284	19.016	16.893	17.189	18.288	18.872
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	25.018	27.456	28.437	32.433	25.042	28.223	29.593	32.809
davon gattungsklassische Deckungswerte	23.018	25.456	26.272	30.194	23.118	26.278	27.406	30.584
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.165	2.238	1.924	1.944	2.188	2.225
Überdeckung in %	56,36%	71,60%	55,53%	70,55%	48,24%	64,20%	61,81%	73,85%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,84%					

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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
bis einschließlich 6 Monate	121	2.034	0	0	121	2.034
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	28	175	1.000	0	-972	175
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	2.161	55	0	0	2.161	55
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	0	2.234	0	1.000	0	1.234
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	9.612	0	15.000	0	-5.388	0
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.172	9.848	0	15.000	2.172	-5.152
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	4.096	5.963	0	0	4.096	5.963
über 10 Jahre	6.829	7.147	0	0	6.829	7.147

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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	29.09.17	30.09.16
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	29.09.17	30.09.16
bis einschließlich 10 Mio.€	10.992	15.068
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	12.025	12.388
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	0	0	2.000	23.018	25.456	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	0	0	2.000	23.018	25.456	0	0

	29.09.17	30.09.16
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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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