



**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 | 73.000 | 73.000 | 77.800 | 81.624 | 64.834 | 66.418 | 81.857 | 82.818 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 86.396 | 77.996 | 93.429 | 87.717 | 83.439 | 78.065 | 94.954 | 87.453 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 81.396 | 72.996 | 88.379 | 82.712 | 79.089 | 73.069 | 89.779 | 82.450 |
| davon sonstige Deckungswerte | 5.000 | 5.000 | 5.050 | 5.005 | 4.350 | 4.996 | 5.175 | 5.003 |
| Überdeckung in % | 18,35% | 6,84% | 20,09% | 7,47% | 28,70% | 17,54% | 16,00% | 5,60% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 6,49% | | | | | |

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 | 0 | 5.000 | 0 | 0 | 0 | 5.000 |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 977 | 0 | 0 | 0 | 0 | 977 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 1.371 | 0 | 0 | 0 | 1.371 | 0 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 273 | 1.467 | 0 | 0 | 273 | 1.467 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 28.478 | 2.428 | 0 | 0 | 28.478 | 2.428 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 6.566 | 28.198 | 0 | 0 | 6.566 | 28.198 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 44.136 | 37.780 | 63.000 | 63.000 | -18.864 | -25.220 |
| über 10 Jahre | 4.595 | 3.122 | 10.000 | 10.000 | -5.405 | -6.878 |

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 | - |
| Europäische Investitionsbank | 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% | 93,59% |

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.€ | 31.028 | 25.661 | | | | | | | |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 50.368 | 52.335 | | | | | | | |
| 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 | 29.09.17 |
| Deutschland | 0 | * | 24.581 | * | 56.815 | * | 0 | * | |
| Europäische Investitionsbank | 0 | * | 0 | * | 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 | 29.09.17 |
| Deutschland | 0 | * | 0 | * | 0 | * | 0 | * | |
| Europäische Investitionsbank | 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 | 29.09.17 |
| Deutschland | 0 | 0 | 24.581 | 17.873 | 56.815 | 55.122 | 0 | 0 | |
| Europäische Investitionsbank | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 5.000 | |
| | 29.09.17 | 30.09.16 | | | | | | | |
| darunter ECA-Finanzierungen | 0 | 0 | | | | | | | |

Vorjahreswerte beziehen sich auf den Gesamtbetrag der Deckungsmasse
* Getrennter Ausweis erst ab Quartal 4/2016

| 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% Rückstandsbetrag | | | | | |
| | 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 |
| Europäische Investitionsbank | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag 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 |
| Europäische Investitionsbank | 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 |