



**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)	
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	73.000	73.000	77.625	80.658	64.307	65.274	81.925	82.865
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	87.078	78.097	94.377	88.017	83.904	78.084	96.148	88.138
davon gattungsklassische Deckungswerte	82.078	73.097	89.345	83.009	79.596	73.085	90.973	83.131
davon sonstige Deckungswerte	5.000	5.000	5.032	5.008	4.308	4.999	5.175	5.006
Überdeckung in %	19,29%	6,98%	21,58%	9,12%	30,47%	19,62%	17,36%	6,36%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,48%					

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	
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	5.000	0	0	0	5.000
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	985	0	0	0	985	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	1.395	0	0	0	1.395	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	300	1.490	0	0	300	1.490
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	20.074	410	0	0	20.074	410
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	15.326	21.620	0	0	15.326	21.620
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	44.359	46.421	63.000	63.000	-18.641	-16.579
über 10 Jahre	4.640	3.157	10.000	10.000	-5.360	-6.843

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	
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16
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%	0	0
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	
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16
Deutschland	0	-	0	-
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.06.17	30.06.16
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	93,60%

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	30.06.17		30.06.16						
bis einschließlich 10 Mio.€	31.268	25.223							
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	50.811	52.874							
mehr als 100 Mio.€	0	0							
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	
Deutschland	0	*	24.645	*	57.433	*	0	*	
Europäische Investitionsbank	0	*	0	*	0	*	0	*	
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	
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		
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	
Deutschland	0	0	24.645	17.405	57.433	55.692	0	0	
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	0	5.000	
	30.06.17	30.06.16							
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					
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16				
Deutschland	0	0	0	0				
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16
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	
	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16	30.06.17	30.06.16
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