



**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)	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	73.000	63.000	79.208	67.107	64.918	53.979	82.698	73.233
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	83.152	79.484	91.688	87.774	81.005	77.377	92.647	90.391
davon gattungsklassische Deckungswerte	78.152	74.484	86.617	82.757	76.718	72.369	87.472	85.376
davon sonstige Deckungswerte	5.000	5.000	5.071	5.017	4.288	5.008	5.175	5.015
Überdeckung in %	13,91%	26,16%	15,76%	30,80%	24,78%	43,35%	12,03%	23,43%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,40%					

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	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	5.000	0	0	0	5.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.443	0	0	0	1.443	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.389	1.536	0	0	2.389	1.536
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	28.075	2.546	0	0	28.075	2.546
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	48.157	67.175	63.000	28.000	-14.843	39.175
über 10 Jahre	3.087	3.226	10.000	35.000	-6.913	-31.774

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	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
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	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
Deutschland	0	-	0	-
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	93,71%

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	30.12.16	30.12.15						
bis einschließlich 10 Mio.€	26.331	25.615						
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	51.821	53.868						
mehr als 100 Mio.€	0	0						
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
Deutschland	0	*	23.574	*	54.578	*	0	*
Europäische Investitionsbank	0	*	0	*	0	*	0	*
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
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	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
Deutschland	0	0	23.574	17.738	54.578	56.745	0	0
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	0	5.000
	30.12.16	30.12.15						
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					
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15				
Deutschland	0	0	0	0				
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
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	
	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15	30.12.16	30.12.15
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