



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

| <b>I) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG zum Gesamtbetrag</b> (Angaben in Tsd. Euro) |          |          |          |          |  |          |   |          |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
|   | Nennwert |          | Barwert  |          | Risikobarwert *)<br>(Verschieb. n. oben) |          | Risikobarwert *)<br>(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  | 73.000   | 63.000   | 78.720   | 70.109   | 64.934                                   | 56.621   | 82.698                                    | 73.233   |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse  | 82.473   | 79.176   | 90.231   | 88.458   | 80.099                                   | 78.195   | 91.515                                    | 89.274   |
| davon gattungsklassische<br>Deckungswerte   | 77.473   | 74.176   | 85.186   | 83.445   | 75.806                                   | 73.191   | 86.340                                    | 84.264   |
| davon sonstige Deckungswerte  | 5.000    | 5.000    | 5.046    | 5.012    | 4.293                                    | 5.004    | 5.175                                     | 5.011    |
| Überdeckung in %  | 12,98%   | 25,68%   | 14,62%   | 26,17%   | 23,35%                                   | 38,10%   | 10,66%                                    | 21,91%   |
| Sichernde Überdeckung gem.<br>§ 4 Abs. 1 PfandBG in %                                     |          |          | 6,41%    |          |  |          |   |          |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

| <b>II) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse</b> (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.  | 0             | 5.000    | 0                | 0        | 0        | 5.000    |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.   | 0             | 0        | 0                | 0        | 0        | 0        |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre   | 1.419         | 0        | 0                | 0        | 1.419    | 0        |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre   | 328           | 1.536    | 0                | 0        | 328      | 1.536    |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre   | 2.022         | 464      | 0                | 0        | 2.022    | 464      |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre   | 29.191        | 2.082    | 0                | 0        | 29.191   | 2.082    |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre  | 46.461        | 66.890   | 63.000           | 28.000   | -16.539  | 38.890   |
| über 10 Jahre   | 3.052         | 3.204    | 10.000           | 35.000   | -6.948   | -31.796  |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

| <b>III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse</b> (Angaben in Tsd. Euro) |          |          |                               |          |  |          |
|--|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
| Weitere Deckung  | Nennwert |          | Anteil am<br>Pfandbriefumlauf |          | Überschreitung<br>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<br>Art der gesetzlichen Begrenzung | § 20 Abs. 2 Nr. 2<br>ohne § 4 Abs. 1<br>Satz 2 Nr. 1 u. 2<br>PfandBG |          | davon Forderungen<br>im Sinne des Art. 129<br>Verordnung (EU)<br>Nr. 575/2013 |          |
|---|--|----------|---|----------|
|   | 31.03.17   | 31.03.16 | 31.03.17  | 31.03.16 |
| Deutschland   | 0  | -        | 0   | -        |
| Europäische Investitionsbank  | 0  | 0        | 0   | 0        |
| Summe   | 0  | 0        | 0   | 0        |

  

|  | 31.03.17 | 31.03.16 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher<br>Pfandbriefe   | 100,00%  | 100,00%  |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher<br>Deckungswerte | 100,00%  | 93,68%   |

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.€  | 26.146   | 25.593   |                                 |          |                                |          |                    |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€   | 51.328   | 53.583   |                                 |          |                                |          |                    |
| 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           |
| Deutschland  | 0        | *        | 23.420                          | *        | 54.054                         | *        | 0                  |
| Europäische Investitionsbank   | 0        | *        | 0                               | *        | 0                              | *        | 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           |
| 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 |
|  | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17                        | 31.03.16 | 31.03.17                       | 31.03.16 | 31.03.17           |
| Deutschland  | 0        | 0        | 23.420                          | 17.738   | 54.054                         | 56.438   | 0                  |
| Europäische Investitionsbank   | 0        | 0        | 0                               | 0        | 0                              | 0        | 5.000              |
|  | 31.03.17 | 31.03.16 |                                 |          |                                |          |                    |
| 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 |          |                                |          |                    |          |
|   | 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        |
| 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 |          |
|   | 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        |
| 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<br>- sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG<br>- 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   |