

## 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)	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	19.045	19.313	17.028	16.918	19.057	19.641
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	27.954	28.872	32.832	34.312	28.416	29.334	33.754	35.531
davon gattungsklassische Deckungswerte	25.954	26.872	30.592	32.078	26.487	27.452	31.491	33.231
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.241	2.234	1.928	1.882	2.263	2.300
Überdeckung in %	74,71%	80,45%	72,39%	77,66%	66,88%	73,39%	77,12%	80,90%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,76%					

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	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	2.086	1.235	0	0	2.086	1.235
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	201	2.185	0	0	201	2.185
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	69	252	1.000	0	-931	252
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.269	97	0	1.000	2.269	-903
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	8.656	2.338	10.000	0	-1.344	2.338
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	7.367	12.629	5.000	15.000	2.367	-2.371
über 10 Jahre	7.306	10.137	0	0	7.306	10.137

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	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
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	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	31.03.16	31.03.15
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)

Deckungsmasse nach Größenklassen	31.03.16	31.03.15
bis einschließlich 10 Mio.€	15.385	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	12.569	-
mehr als 100 Mio.€	0	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	0	2.000	2.000	25.954	26.872	0	0

	31.03.16	31.03.15
darunter ECA-Finanzierungen	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	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
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	
	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15	31.03.16	31.03.15
Deutschland	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