

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)	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	19.016	19.077	17.189	16.899	18.872	19.456
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	27.456	28.415	32.433	32.759	28.223	28.351	32.809	34.594
davon gattungsklassische Deckungswerte	25.456	26.415	30.194	30.584	26.278	26.501	30.584	32.332
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.238	2.175	1.944	1.850	2.225	2.263
Überdeckung in %	71,60%	77,59%	70,55%	71,72%	64,20%	67,77%	73,85%	77,81%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,77%					

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	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
bis einschließlich 6 Monate	2.034	1.203	0	0	2.034	1.203
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	175	2.136	0	0	175	2.136
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	55	0	0	0	55	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.234	310	1.000	0	1.234	310
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	2.304	0	1.000	0	1.304
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	9.848	0	15.000	0	-5.152	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	5.963	14.996	0	15.000	5.963	-4
über 10 Jahre	7.147	7.465	0	0	7.147	7.465

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	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
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	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.09.16	30.09.15
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	30.09.16	30.09.15
bis einschließlich 10 Mio.€	15.068	15.664
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	12.388	12.750
mehr als 100 Mio.€	0	0

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
Deutschland	0	0	2.000	2.000	25.456	26.415	0	0

	30.09.16	30.09.15
darunter ECA-Finanzierungen	0	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	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
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	
	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15	30.09.16	30.09.15
Deutschland	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