

**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	210.000	200.000	238.893	230.353	216.500	206.611	240.499	234.278
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	312.948	314.183	344.320	353.640	325.200	326.914	344.707	356.412
davon gattungsklassische Deckungswerte	304.948	306.183	336.259	345.562	317.165	318.861	336.644	348.325
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.061	8.078	8.035	8.053	8.063	8.087
Überdeckung in %	49,02%	57,09%	44,13%	53,52%	50,21%	58,23%	43,33%	52,13%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,37%					

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.	30.000	0	0	0	30.000	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	10.000	0	0	0	10.000	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	40.000	30.000	0	0	40.000	30.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	205.000	50.000	5.000	0	200.000	50.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	205.000	50.000	5.000	-50.000	200.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	0	110.000	50.000	-110.000	-50.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.000	3.000	45.000	125.000	-42.000	-122.000
über 10 Jahre	24.948	26.183	0	20.000	24.948	6.183

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	76,19%	75,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,44%	97,45%

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.€	28.000	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	284.948	-
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	285.000	285.000	24.948	26.183	3.000	3.000

	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