

**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 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 39.341 | 40.340 | 43.340 | 45.245 | 36.435 | 37.539 | 44.618 | 47.142 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 39.341 | 40.340 | 43.340 | 45.245 | 36.435 | 37.539 | 44.618 | 47.142 |
| davon sonstige Deckungswerte | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Überdeckung in % | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 0,00% | | | | | |

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. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 11.092 | 11.401 | 0 | 0 | 11.092 | 11.401 |
| über 10 Jahre | 28.250 | 28.940 | 0 | 0 | 28.250 | 28.940 |

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 |
| Summe | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | 31.03.16 | 31.03.15 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 0,00% | 0,00% |
| 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.€ | 0 | - |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 39.341 | - |
| 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 | 0 | 0 | 0 | 0 | 39.341 | 40.340 |

| | 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% Rückstandsbetrag | |
|--------------------------------------|--|----------|--|----------|
| | 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% Rückstandsbetrag 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 |