



**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)	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	0	0	0	0	0	0	0	0
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	37.783	38.811	40.466	43.126	34.909	36.461	41.922	43.452
davon gattungsklassische Deckungswerte	37.783	38.811	40.466	43.126	34.909	36.461	41.922	43.452
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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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	10.666	0	0	0	10.666	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	27.117	38.811	0	0	27.117	38.811
über 10 Jahre	0	0	0	0	0	0

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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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 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			
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16		
Deutschland	0	0	0	0		
Summe	0	0	0	0		
	29.09.17	30.09.16				
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)								
Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen	29.09.17	30.09.16						
bis einschließlich 10 Mio.€	0	0						
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	37.783	38.811						
mehr als 100 Mio.€	0	0						
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	-	0	-	0	-	0	-
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	-	0	-	37.783	38.811	0	-
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
Deutschland	0	0	0	0	37.783	38.811	0	0
	29.09.17	30.09.16						
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% Rückstandsbetrag					
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16				
Deutschland	0	0	0	0				
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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	
	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16	29.09.17	30.09.16
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