

**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 Mio. Euro)

| | Nennwert | | Barwert | | Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben) | | Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten) | |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 45,0 | 30,0 | 48,4 | 33,9 | 41,0 | 28,9 | 50,0 | 34,3 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 72,4 | 62,2 | 77,7 | 69,5 | 63,7 | 57,7 | 84,1 | 73,5 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 67,4 | 57,2 | 72,6 | 64,3 | 59,0 | 52,7 | 79,0 | 68,4 |
| davon sonstige Deckungswerte | 5,0 | 5,0 | 5,1 | 5,2 | 4,7 | 5,1 | 5,2 | 5,2 |
| Überdeckung in % | 60,93% | 107,24% | 60,58% | 104,96% | 55,48% | 99,78% | 68,17% | 114,13% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 10,56% | | | | | |

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 Mio. Euro)

| | Deckungsmasse | | Pfandbriefumlauf | | Überhang | |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| bis einschließlich 6 Monate | 2,5 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 2,5 | 0,0 |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon. | 0,6 | 7,9 | 0,0 | 0,0 | 0,6 | 7,9 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 0,0 | 2,5 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 2,5 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 3,5 | 0,6 | 0,0 | 0,0 | 3,5 | 0,6 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 1,3 | 3,6 | 0,0 | 0,0 | 1,3 | 3,6 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 0,0 | 1,4 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 1,4 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 7,5 | 0,0 | 45,0 | 30,0 | -37,5 | -30,0 |
| über 10 Jahre | 57,1 | 46,2 | 0,0 | 0,0 | 57,1 | 46,2 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)

| Weitere Deckung | Nennwert | | Anteil am Pfandbriefumlauf | | Überschreitung gesetzlicher Grenzen | |
|--------------------------------|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG | 0,0 | 0,0 | 0,00% | 0,00% | 0,0 | 0,0 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG | 0,0 | 0,0 | 0,00% | 0,00% | | |
| 1. Halbsatz (10,00%) | | | | | 0,0 | 0,0 |
| 2. Halbsatz (2,00%) | | | | | 0,0 | 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 | |
|---|--|----------|---|----------|
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| | 31.03.17 | 31.03.16 |
|--|----------|----------|
| 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 Mio. Euro) | | | | | | | | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen | 31.03.17 | | 31.03.16 | | | | | |
| bis einschließlich 10 Mio.€ | 36,7 | | 42,6 | | | | | |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 30,7 | | 19,5 | | | | | |
| mehr als 100 Mio.€ | 0,0 | | 0,0 | | | | | |
| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Deutschland | 0,0 | - | 12,8 | - | 26,6 | - | 28,1 | - |
| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Deutschland | 0,0 | - | 0,0 | - | 0,0 | - | 0,0 | - |
| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 12,8 | 14,7 | 26,6 | 19,8 | 28,1 | 27,6 |
| | 31.03.17 | | 31.03.16 | | | | | |
| darunter ECA-Finanzierungen | 0,0 | | 0,0 | | | | | |

| V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Mio. Euro) | | | | | | | | |
|---|--|----------|---|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| Rückständige Leistungen nach Ländern | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | | Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag | | | | | |
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | | | | |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | | | | |
| Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
| | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 | 31.03.17 | 31.03.16 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 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 |