

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)	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	17.741	18.243	16.657	16.752	18.930	18.288
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	24.224	25.171	27.266	28.705	24.268	25.156	31.157	29.902
davon gattungsklassische Deckungswerte	22.224	23.171	25.091	26.510	22.298	23.213	28.747	27.677
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.175	2.195	1.969	1.943	2.410	2.225
Überdeckung in %	51,40%	57,32%	53,69%	57,35%	45,69%	50,17%	64,59%	63,50%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			12,26%					

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	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
bis einschließlich 6 Monate	7	133	1.000	0	-993	133
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	2.084	35	0	1.000	2.084	-966
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	2.161	0	0	0	2.161
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	8.210	0	15.000	0	-6.790	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	1.351	9.667	0	15.000	1.351	-5.333
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.342	172	0	0	2.342	172
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.639	6.096	0	0	3.639	6.096
über 10 Jahre	6.590	6.908	0	0	6.590	6.908

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	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
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	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	29.06.18	30.06.17
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)

Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen	29.06.18	30.06.17
bis einschließlich 10 Mio.€	10.470	11.055
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	11.753	12.116
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
Deutschland	0	0	0	0	22.224	23.171	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
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	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
Deutschland	0	0	0	0	22.224	23.171	0	0

	29.06.18	30.06.17
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	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
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	
	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17	29.06.18	30.06.17
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