

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 |