

**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)	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	195.000	200.000	209.467	218.039	200.387	205.487	220.018	219.222
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	363.408	437.616	371.287	451.058	359.058	436.186	390.436	453.944
davon gattungsklassische Deckungswerte	308.408	429.616	316.041	443.029	303.950	428.189	332.231	445.919
davon sonstige Deckungswerte	55.000	8.000	55.246	8.029	55.107	7.997	58.205	8.025
Überdeckung in %	86,36%	118,81%	77,25%	106,87%	79,18%	112,27%	77,46%	107,07%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,84%					

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	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
bis einschließlich 6 Monate	203.907	235.478	50.000	5.000	153.907	230.478
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	425	68.220	0	0	425	68.220
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	97.000	0	100.000	50.000	-3.000	-50.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	18.220	0	10.000	0	8.220	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	3.000	97.000	5.000	110.000	-2.000	-13.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	0	0	5.000	0	-5.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	5.057	0	10.000	0	-4.943	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	1.782	1.119	20.000	30.000	-18.218	-28.881
über 10 Jahre	34.016	35.799	0	0	34.016	35.799

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	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
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	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	29.03.19	29.03.18
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	74,36%	75,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	76,61%	98,17%

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	29.03.19	29.03.18						
bis einschließlich 10 Mio.€	54.509	36.126						
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	253.898	393.490						
mehr als 100 Mio.€	0	0						
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
Deutschland	0	0	0	200.000	248.353	210.270	60.054	19.346
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
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	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
Deutschland	0	0	0	200.000	248.353	210.270	60.054	19.346
	29.03.19	29.03.18						
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					
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18				
Deutschland	0	0	0	0				
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
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	
	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18	29.03.19	29.03.18
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