

**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)	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	200.000	200.000	218.039	222.810	205.487	206.461	219.222	224.226
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	437.616	281.677	451.058	302.154	436.186	290.742	453.944	303.005
davon gattungsklassische Deckungswerte	429.616	273.677	443.029	294.109	428.189	282.725	445.919	294.962
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.029	8.044	7.997	8.017	8.025	8.043
Überdeckung in %	118,81%	40,84%	106,87%	35,61%	112,27%	40,82%	107,07%	35,13%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,68%					

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	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
bis einschließlich 6 Monate	235.478	18.000	5.000	0	230.478	18.000
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	68.220	40.000	0	0	68.220	40.000
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	200.000	50.000	5.000	-50.000	195.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	97.000	0	110.000	50.000	-13.000	-50.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	0	5.000	110.000	-5.000	-110.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	0	0	5.000	0	-5.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	1.119	0	30.000	30.000	-28.881	-30.000
über 10 Jahre	35.799	23.677	0	0	35.799	23.677

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	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
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	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	29.03.18	31.03.17
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	75,00%	75,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	98,17%	97,16%

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	29.03.18	31.03.17
bis einschließlich 10 Mio.€	36.126	20.000
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	393.490	253.677
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
Deutschland	0	0	200.000	250.000	210.270	23.677	19.346	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
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	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
Deutschland	0	0	200.000	250.000	210.270	23.677	19.346	0

	29.03.18	31.03.17
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	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
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	
	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17	29.03.18	31.03.17
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