

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)	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	200.000	210.000	219.015	234.951	205.513	215.593	220.234	236.364
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	437.606	311.998	452.937	335.181	436.412	321.814	455.692	335.807
davon gattungsklassische Deckungswerte	429.606	303.998	444.904	327.132	428.426	313.810	447.664	327.761
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.033	8.049	7.985	8.004	8.028	8.046
Überdeckung in %	118,80%	48,57%	106,81%	42,66%	112,35%	49,27%	106,91%	42,07%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,67%					

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	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
bis einschließlich 6 Monate	213.000	30.000	5.000	0	208.000	30.000
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	77.015	10.000	0	0	77.015	10.000
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	18.220	190.000	0	5.000	18.220	185.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	50.000	50.000	0	-50.000	50.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	92.000	5.000	100.000	50.000	-8.000	-45.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	0	10.000	100.000	-10.000	-100.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	3.000	5.000	10.000	-5.000	-7.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	1.134	0	30.000	45.000	-28.866	-45.000
über 10 Jahre	36.237	23.998	0	0	36.237	23.998

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	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
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	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	29.12.17	30.12.16
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	75,00%	76,19%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	98,17%	97,44%

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	29.12.17		30.12.16					
bis einschließlich 10 Mio.€	38.149	20.000						
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	391.457	283.998						
mehr als 100 Mio.€	0	0						
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
Deutschland	0	0	240.000	280.000	170.237	23.998	19.369	0
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
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	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
Deutschland	0	0	240.000	280.000	170.237	23.998	19.369	0
	29.12.17	30.12.16						
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					
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16				
Deutschland	0	0	0	0				
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
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	
	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16	29.12.17	30.12.16
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