



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	73.000	73.000	77.702	78.720	65.524	64.934	81.736	82.698
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	94.574	82.473	100.701	90.231	90.291	80.099	102.818	91.515
davon gattungsklassische Deckungswerte	89.824	77.473	95.933	85.186	86.137	75.806	97.926	86.340
davon sonstige Deckungswerte	4.750	5.000	4.767	5.046	4.153	4.293	4.893	5.175
Überdeckung in %	29,55%	12,98%	29,60%	14,62%	37,80%	23,35%	25,79%	10,66%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,14%					

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	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	962	0	0	0	962	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	1.321	0	0	0	1.321	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	1.419	0	0	0	1.419
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.272	328	0	0	1.272	328
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	28.158	2.022	0	0	28.158	2.022
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	5.213	29.191	10.000	0	-4.787	29.191
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	48.560	46.461	53.000	63.000	-4.440	-16.539
über 10 Jahre	9.087	3.052	10.000	10.000	-913	-6.948

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	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	29.03.18	31.03.17
bis einschließlich 10 Mio.€	40.479	26.146
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	49.345	51.328
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	23.942	23.420	65.882	54.054	0	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	23.942	23.420	65.882	54.054	0	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