



## 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	73.000	73.000	77.850	79.208	65.243	64.918	81.736	82.698
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	89.189	83.152	95.794	91.688	85.768	81.005	97.544	92.647
davon gattungsklassische Deckungswerte	84.439	78.152	91.023	86.617	81.637	76.718	92.651	87.472
davon sonstige Deckungswerte	4.750	5.000	4.771	5.071	4.131	4.288	4.893	5.175
Überdeckung in %	22,18%	13,91%	23,05%	15,76%	31,46%	24,78%	19,34%	12,03%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,13%					

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	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	2.316	0	0	0	2.316	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.307	1.443	0	0	1.307	1.443
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	27.217	2.389	0	0	27.217	2.389
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	6.453	28.075	10.000	0	-3.547	28.075
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	44.965	48.157	53.000	63.000	-8.035	-14.843
über 10 Jahre	6.931	3.087	10.000	10.000	-3.069	-6.913

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	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	29.12.17	30.12.16
bis einschließlich 10 Mio.€	34.698	26.331
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	49.741	51.821
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	24.006	23.574	60.432	54.578	0	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	24.006	23.574	60.432	54.578	0	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