



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) | |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 73.000 | 73.000 | 78.420 | 77.850 | 67.156 | 65.243 | 92.190 | 81.736 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 96.017 | 89.189 | 101.928 | 95.794 | 92.296 | 85.768 | 113.292 | 97.544 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 96.017 | 84.439 | 101.928 | 91.023 | 92.296 | 81.637 | 113.292 | 92.651 |
| davon sonstige Deckungswerte | 0 | 4.750 | 0 | 4.771 | 0 | 4.131 | 0 | 4.893 |
| Überdeckung in % | 31,53% | 22,18% | 29,98% | 23,05% | 37,44% | 31,46% | 22,89% | 19,34% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 6,48% | | | | | |

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 | |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| bis einschließlich 6 Monate | 1.245 | 0 | 0 | 0 | 1.245 | 0 |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 137 | 2.316 | 0 | 0 | 137 | 2.316 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 1.030 | 0 | 0 | 0 | 1.030 | 0 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 27.007 | 1.307 | 0 | 0 | 27.007 | 1.307 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 6.969 | 27.217 | 10.000 | 0 | -3.031 | 27.217 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 23.768 | 6.453 | 10.000 | 10.000 | 13.768 | -3.547 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 24.632 | 44.965 | 43.000 | 53.000 | -18.368 | -8.035 |
| über 10 Jahre | 11.229 | 6.931 | 10.000 | 10.000 | 1.229 | -3.069 |

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 | |
|--------------------------------|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| 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 | |
|---|--|----------|---|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| Deutschland | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Summe | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | 28.12.18 | 29.12.17 |
|--|----------|----------|
| 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 | 28.12.18 | 29.12.17 |
|---|----------|----------|
| bis einschließlich 10 Mio.€ | 48.389 | 34.698 |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 47.627 | 49.741 |
| mehr als 100 Mio.€ | 0 | 0 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| Deutschland | 0 | 0 | 28.374 | 24.006 | 67.643 | 60.432 | 0 | 0 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| 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 | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| Deutschland | 0 | 0 | 28.374 | 24.006 | 67.643 | 60.432 | 0 | 0 |

| | 28.12.18 | 29.12.17 |
|-----------------------------|----------|----------|
| 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 | |
|--------------------------------------|--|----------|---|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| Deutschland | 0 | 0 | 0 | 0 |

| Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| 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 | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 | 28.12.18 | 29.12.17 |
| 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 |