

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 | 16.000 | 16.000 | 17.886 | 18.437 | 16.702 | 16.842 | 19.193 | 18.473 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 24.549 | 25.498 | 27.672 | 29.352 | 24.550 | 25.620 | 31.723 | 30.462 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 22.549 | 23.498 | 25.509 | 27.153 | 22.604 | 23.686 | 29.312 | 28.237 |
| davon sonstige Deckungswerte | 2.000 | 2.000 | 2.163 | 2.199 | 1.946 | 1.935 | 2.411 | 2.225 |
| Überdeckung in % | 53,43% | 59,36% | 54,72% | 59,20% | 46,99% | 52,12% | 65,29% | 64,90% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 12,09% | | | | | |

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. | 14 | 148 | 1.000 | 0 | -986 | 148 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 2.123 | 41 | 0 | 0 | 2.123 | 41 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 0 | 0 | 0 | 1.000 | 0 | -1.000 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 5.094 | 2.198 | 10.000 | 0 | -4.906 | 2.198 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 4.551 | 8.460 | 5.000 | 10.000 | -449 | -1.540 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 2.355 | 1.463 | 0 | 5.000 | 2.355 | -3.537 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 3.743 | 6.200 | 0 | 0 | 3.743 | 6.200 |
| über 10 Jahre | 6.670 | 6.988 | 0 | 0 | 6.670 | 6.988 |

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.€ | 10.705 | 11.291 |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 11.844 | 12.207 |
| 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 | 0 | 0 | 22.549 | 23.498 | 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 | 0 | 0 | 22.549 | 23.498 | 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 |