

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 Mio. Euro)

| | Nennwert | | Barwert | | Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben) | | Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten) | |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 50,0 | 50,0 | 50,6 | 50,6 | 43,7 | 43,9 | 52,2 | 52,6 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 101,3 | 104,6 | 113,0 | 117,7 | 98,1 | 101,2 | 118,0 | 123,7 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 90,3 | 93,6 | 101,6 | 106,3 | 88,0 | 91,3 | 106,3 | 111,9 |
| davon sonstige Deckungswerte | 11,0 | 11,0 | 11,4 | 11,4 | 10,1 | 9,9 | 11,7 | 11,8 |
| Überdeckung in % | 102,59% | 109,23% | 123,41% | 132,49% | 124,49% | 130,43% | 125,90% | 135,09% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 22,47% | | | | | |

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 Mio. Euro)

| | Deckungsmasse | | Pfandbriefumlauf | | Überhang | |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| bis einschließlich 6 Monate | 4,3 | 5,1 | 0,0 | 0,0 | 4,3 | 5,1 |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon. | 4,6 | 0,8 | 0,0 | 10,0 | 4,6 | -9,2 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 0,2 | 2,1 | 0,0 | 0,0 | 0,2 | 2,1 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 1,4 | 3,9 | 0,0 | 0,0 | 1,4 | 3,9 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 5,0 | 3,1 | 10,0 | 0,0 | -5,0 | 3,1 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 7,2 | 4,1 | 0,0 | 10,0 | 7,2 | -5,9 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 2,8 | 7,5 | 10,0 | 0,0 | -7,2 | 7,5 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 33,5 | 32,6 | 20,0 | 20,0 | 13,5 | 12,6 |
| über 10 Jahre | 42,4 | 45,5 | 10,0 | 10,0 | 32,4 | 35,5 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)

| Weitere Deckung | Nennwert | | Anteil am Pfandbriefumlauf | | Überschreitung gesetzlicher Grenzen | |
|--------------------------------|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG | 0,0 | 0,0 | 0,00% | 0,00% | 0,0 | 0,0 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG | 0,0 | 0,0 | 0,00% | 0,00% | | |
| 1. Halbsatz (10,00%) | | | | | 0,0 | 0,0 |
| 2. Halbsatz (2,00%) | | | | | 0,0 | 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 | |
|---|--|----------|---|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| | 29.06.18 | 30.06.17 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 100,00% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 96,90% | 96,92% |

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 Mio. Euro)

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen | 29.06.18 | 30.06.17 |
|---|----------|----------|
| bis einschließlich 10 Mio.€ | 52,1 | 54,0 |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 38,2 | 39,7 |
| mehr als 100 Mio.€ | 0,0 | 0,0 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,4 | 0,7 | 25,2 | 29,1 | 64,7 | 63,8 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 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 | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,4 | 0,7 | 25,2 | 29,1 | 64,7 | 63,8 |

| | 29.06.18 | 30.06.17 |
|-----------------------------|----------|----------|
| darunter ECA-Finanzierungen | 0,0 | 0,0 |

V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Mio. Euro)

| Rückständige Leistungen nach Ländern | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | | Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag | |
|--------------------------------------|--|----------|---|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 | 29.06.18 | 30.06.17 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 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 |