

**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)	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	145.000	195.000	156.624	209.361	149.390	198.636	164.773	222.433
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	310.382	341.368	320.732	347.492	308.547	334.638	338.601	363.526
davon gattungsklassische Deckungswerte	255.382	333.368	265.331	339.458	253.465	326.621	280.956	354.985
davon sonstige Deckungswerte	55.000	8.000	55.401	8.034	55.082	8.018	57.645	8.540
Überdeckung in %	114,06%	75,06%	104,78%	65,98%	106,54%	68,47%	105,50%	63,43%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,15%					

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	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
bis einschließlich 6 Monate	139.418	182.096	0	0	139.418	182.096
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	100.490	19.995	100.000	50.000	490	-30.005
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	18.220	429	10.000	0	8.220	429
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	97.001	0	100.000	0	-2.999
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	3.000	0	5.000	10.000	-2.000	-10.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	5.026	0	0	5.000	5.026	-5.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	5.088	10.000	0	-10.000	5.088
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	11.122	1.844	20.000	30.000	-8.878	-28.156
über 10 Jahre	33.106	34.914	0	0	33.106	34.914

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	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
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	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.09.19	28.09.18
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	74,36%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	72,61%	97,66%

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	30.09.19	28.09.18
bis einschließlich 10 Mio.€	62.438	75.513
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	192.944	257.856
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
Deutschland	0	0	0	0	188.633	298.216	66.749	35.153

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
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	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
Deutschland	0	0	0	0	188.633	298.216	66.749	35.153

	30.09.19	28.09.18
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	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
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	
	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18	30.09.19	28.09.18
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