

**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)	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	35.000	145.000	40.102	155.126	37.120	150.729	43.457	160.127
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	223.166	309.613	230.402	318.701	218.599	305.137	244.584	336.545
davon gattungsklassische Deckungswerte	213.166	199.613	220.273	207.974	209.583	198.450	233.171	220.065
davon sonstige Deckungswerte	10.000	110.000	10.129	110.727	9.016	106.687	11.413	116.480
Überdeckung in %	537,62%	113,53%	474,54%	105,45%	488,90%	102,44%	462,82%	110,17%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			25,26%					

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	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
bis einschließlich 6 Monate	93.569	224.648	0	100.000	93.569	124.648
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	4.900	5.000	10.000	-5.000	-5.100
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	42.920	3.000	0	0	42.920	3.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	10.762	0	0	5.000	10.762	-5.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	22.150	978	10.000	0	12.150	978
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.169	4.000	0	10.000	2.169	-6.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	10.000	2.734	20.000	0	-10.000	2.734
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.024	28.272	0	20.000	3.024	8.272
über 10 Jahre	38.572	41.080	0	0	38.572	41.080

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	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
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	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.06.21	30.06.20
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	72,55%

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	30.06.21	30.06.20						
bis einschließlich 10 Mio.€	69.596	60.165						
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	143.570	139.447						
mehr als 100 Mio.€	0	0						
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
Deutschland	0	0	0	0	166.865	132.780	46.302	66.832
Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
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	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
Deutschland	0	0	0	0	166.865	132.780	46.302	66.832
	30.06.21	30.06.20						
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					
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	0			
Deutschland	0	0	0	0	0			
Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
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	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
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