

**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)	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	145.000	195.000	155.877	209.962	149.659	200.046	162.878	221.781
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	318.855	332.889	327.042	339.362	314.348	327.585	344.818	354.103
davon gattungsklassische Deckungswerte	233.855	324.889	241.662	331.326	229.740	319.614	256.540	345.589
davon sonstige Deckungswerte	85.000	8.000	85.380	8.036	84.608	7.971	88.279	8.513
Überdeckung in %	119,90%	70,71%	109,81%	61,63%	110,04%	63,75%	111,70%	59,66%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,16%					

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	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
bis einschließlich 6 Monate	184.503	184.114	0	0	184.503	184.114
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	73.220	9.995	100.000	50.000	-26.780	-40.005
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	427	10.000	0	-10.000	427
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	3.000	97.000	0	100.000	3.000	-3.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	0	0	5.000	10.000	-5.000	-10.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	5.010	0	0	5.000	5.010	-5.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	687	5.073	10.000	0	-9.313	5.073
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	10.121	1.813	20.000	30.000	-9.879	-28.187
über 10 Jahre	42.315	34.467	0	0	42.315	34.467

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	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
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	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.12.19	28.12.18
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	74,36%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	73,34%	97,60%

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	30.12.19	28.12.18
bis einschließlich 10 Mio.€	71.187	77.524
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	162.668	247.365
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
Deutschland	0	0	0	0	177.313	279.789	56.542	45.101

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
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	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
Deutschland	0	0	0	0	177.313	279.789	56.542	45.101

	30.12.19	28.12.18
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	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
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	
	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18	30.12.19	28.12.18
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