

**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) | |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 145.000 | 195.000 | 155.126 | 210.061 | 150.729 | 201.814 | 160.127 | 219.344 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 309.613 | 358.882 | 318.701 | 367.887 | 305.137 | 355.542 | 336.545 | 385.881 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 199.613 | 303.882 | 207.974 | 312.513 | 198.450 | 300.766 | 220.065 | 327.896 |
| davon sonstige Deckungswerte | 110.000 | 55.000 | 110.727 | 55.374 | 106.687 | 54.776 | 116.480 | 57.985 |
| Überdeckung in % | 113,53% | 84,04% | 105,45% | 75,13% | 102,44% | 76,17% | 110,17% | 75,93% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 21,62% | | | | | |

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 | |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| bis einschließlich 6 Monate | 224.648 | 193.872 | 100.000 | 50.000 | 124.648 | 143.872 |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon. | 4.900 | 3.913 | 10.000 | 0 | -5.100 | 3.913 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 3.000 | 97.003 | 0 | 100.000 | 3.000 | -2.997 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 0 | 18.220 | 5.000 | 10.000 | -5.000 | 8.220 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 978 | 3.000 | 0 | 5.000 | 978 | -2.000 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 4.000 | 1.042 | 10.000 | 0 | -6.000 | 1.042 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 2.734 | 4.000 | 0 | 10.000 | 2.734 | -6.000 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 28.272 | 4.270 | 20.000 | 20.000 | 8.272 | -15.730 |
| über 10 Jahre | 41.080 | 33.563 | 0 | 0 | 41.080 | 33.563 |

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 | |
|--------------------------------|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| 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 | |
|---|--|----------|---|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| Deutschland | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Summe | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | 30.06.20 | 28.06.19 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 74,36% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 72,55% | 76,32% |

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 | 30.06.20 | 28.06.19 |
|---|----------|----------|
| bis einschließlich 10 Mio.€ | 60.165 | 60.474 |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 139.447 | 243.408 |
| mehr als 100 Mio.€ | 0 | 0 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| Deutschland | 0 | 0 | 0 | 0 | 132.780 | 243.875 | 66.832 | 60.007 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| 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 | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| Deutschland | 0 | 0 | 0 | 0 | 132.780 | 243.875 | 66.832 | 60.007 |

| | 30.06.20 | 28.06.19 |
|-----------------------------|----------|----------|
| 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 | |
|--------------------------------------|--|----------|---|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| Deutschland | 0 | 0 | 0 | 0 |

| Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| 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 | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 | 30.06.20 | 28.06.19 |
| 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 |