

**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)	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	45.000	145.000	51.343	156.624	47.526	149.390	55.695	164.773
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	127.360	310.382	136.015	320.732	124.012	308.547	151.008	338.601
davon gattungsklassische Deckungswerte	102.360	255.382	110.442	265.331	101.671	253.465	121.635	280.956
davon sonstige Deckungswerte	25.000	55.000	25.574	55.401	22.342	55.082	29.373	57.645
Überdeckung in %	183,02%	114,06%	164,91%	104,78%	160,93%	106,54%	171,13%	105,50%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			49,81%					

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	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
bis einschließlich 6 Monate	45.128	139.418	10.000	0	35.128	139.418
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	4.950	100.490	0	100.000	4.950	490
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	3.000	18.220	5.000	10.000	-2.000	8.220
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	4.962	3.000	0	5.000	4.962	-2.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	5.026	10.000	0	-10.000	5.026
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	590	0	20.000	10.000	-19.410	-10.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	28.272	11.122	0	20.000	28.272	-8.878
über 10 Jahre	40.458	33.106	0	0	40.458	33.106

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	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
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	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.09.20	30.09.19
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	72,61%

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	30.09.20	30.09.19
bis einschließlich 10 Mio.€	40.497	62.438
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	61.863	192.944
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
Deutschland	0	0	0	0	82.588	188.633	19.772	66.749

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
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	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
Deutschland	0	0	0	0	82.588	188.633	19.772	66.749

	30.09.20	30.09.19
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	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
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	
	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19	30.09.20	30.09.19
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