

**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)	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	45.000	145.000	51.328	155.877	47.805	149.659	55.329	162.878
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	220.822	318.855	229.605	327.042	216.248	314.348	245.921	344.818
davon gattungsklassische Deckungswerte	195.822	233.855	204.023	241.662	193.761	229.740	216.722	256.540
davon sonstige Deckungswerte	25.000	85.000	25.582	85.380	22.487	84.608	29.199	88.279
Überdeckung in %	390,72%	119,90%	347,33%	109,81%	352,35%	110,04%	344,47%	111,70%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			49,84%					

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	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
bis einschließlich 6 Monate	97.894	184.503	10.000	0	87.894	184.503
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	17.900	73.220	0	100.000	17.900	-26.780
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	0	5.000	10.000	-5.000	-10.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	24.700	3.000	0	0	24.700	3.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	9.895	0	0	5.000	9.895	-5.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	557	5.010	10.000	0	-9.443	5.010
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.896	687	20.000	10.000	-18.104	-9.313
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	28.148	10.121	0	20.000	28.148	-9.879
über 10 Jahre	39.833	42.315	0	0	39.833	42.315

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	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
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	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.12.20	30.12.19
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	73,34%

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	30.12.20	30.12.19
bis einschließlich 10 Mio.€	62.939	71.187
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	132.883	162.668
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
Deutschland	0	0	0	0	149.204	177.313	46.618	56.542

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
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	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
Deutschland	0	0	0	0	149.204	177.313	46.618	56.542

	30.12.20	30.12.19
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	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
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	
	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19	30.12.20	30.12.19
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