

**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)	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	145.000	195.000	154.955	209.467	149.654	200.387	160.944	220.018
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	349.883	363.408	358.443	371.287	347.028	359.058	374.914	390.436
davon gattungsklassische Deckungswerte	264.883	308.408	273.229	316.041	261.952	303.950	287.374	332.231
davon sonstige Deckungswerte	85.000	55.000	85.215	55.246	85.076	55.107	87.539	58.205
Überdeckung in %	141,30%	86,36%	131,32%	77,25%	131,89%	79,18%	132,95%	77,46%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,18%					

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	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
bis einschließlich 6 Monate	266.453	203.907	100.000	50.000	166.453	153.907
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	23.120	425	10.000	0	13.120	425
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	97.000	0	100.000	0	-3.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	3.000	18.220	5.000	10.000	-2.000	8.220
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	0	3.000	0	5.000	0	-2.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	4.994	0	10.000	0	-5.006	0
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	655	5.057	0	10.000	655	-4.943
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	9.962	1.782	20.000	20.000	-10.038	-18.218
über 10 Jahre	41.699	34.016	0	0	41.699	34.016

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	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
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	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	31.03.20	29.03.19
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	74,36%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	75,71%	76,61%

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	31.03.20	29.03.19
bis einschließlich 10 Mio.€	85.512	54.509
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	179.371	253.898
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
Deutschland	0	0	0	0	193.548	248.353	71.336	60.054

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
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	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
Deutschland	0	0	0	0	193.548	248.353	71.336	60.054

	31.03.20	29.03.19
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	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
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	
	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19	31.03.20	29.03.19
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