



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	73.000	73.000	79.985	78.420	69.963	67.156	91.997	92.190
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	91.845	96.017	97.495	101.928	89.709	92.296	106.585	113.292
davon gattungsklassische Deckungswerte	91.845	96.017	97.495	101.928	89.709	92.296	106.585	113.292
davon sonstige Deckungswerte	0	0	0	0	0	0	0	0
Überdeckung in %	25,82%	31,53%	21,89%	29,98%	28,22%	37,44%	15,86%	22,89%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,42%					

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	27	1.245	0	0	27	1.245
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	1.628	0	0	0	1.628	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	17.599	137	0	0	17.599	137
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	7.867	1.030	0	0	7.867	1.030
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	6.464	27.007	10.000	0	-3.536	27.007
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	24.292	6.969	10.000	10.000	14.292	-3.031
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	9.609	23.768	8.000	10.000	1.609	13.768
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.783	24.632	45.000	43.000	-31.217	-18.368
über 10 Jahre	10.577	11.229	0	10.000	10.577	1.229

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
Summe	0	0	0	0

	30.12.19	28.12.18
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	100,00%

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.€	46.365	48.389
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	45.480	47.627
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	27.546	28.374	64.299	67.643	0	0

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	27.546	28.374	64.299	67.643	0	0

	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