

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress*	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	40,00	40,00	42,64	43,37	39,83	40,00
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	140,57	178,35	147,89	194,77	135,67	174,24
davon Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	251,42%	345,87%	246,82%	349,09%	240,65%	335,62%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	II 2021			II 2020		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	41,74	-	41,74	42,40	-	42,40
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	3,22	-	3,22	14,81	-	14,81
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	4,07	-	4,07	2,78	-	2,78
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	2,84	-	2,84	3,07	-	3,07
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	18,37	35,00	16,63	7,90	-	7,90
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	11,84	-	11,84	22,88	35,00	12,12
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	12,90	-	12,90	11,93	-	11,93
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	29,76	5,00	24,76	39,47	5,00	34,47
über 10 Jahre	15,81	-	15,81	33,12	-	33,12

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2021	II 2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	57,60%	64,54%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt dynamisch.

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs (nominal)	II 2021		II 2020	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Gesamte Deckungsmasse	140,57	351,42%	178,35	445,87%
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	140,57	351,42%	178,35	445,87%
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	2,00	5,00%	7,50	18,75%
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	-	0,00%	-	0,00%
davon Sichernde Überdeckung nach § 20 (2) Nr. 2 PfandBG	-	0,00%	-	0,00%

Zur Deckung verwendete Forderungen	II 2021	II 2020
bis zu 10 Millionen €	49,82	61,40
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	90,75	116,94
mehr als 100 Millionen €	-	-

§ 28 (3) Nr. 2 Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen	Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Gesamt	darin enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung
		geschuldet von	gewährleistet von	geschuldet von	gewährleistet von	geschuldet von	gewährleistet von	geschuldet von	gewährleistet von		
		Land	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021		
Bundesrepublik Deutschland	II 2021	-	-	1,00	19,45	76,48	4,51	38,13	-	139,57	-
	II 2020	-	-	1,50	43,03	82,03	8,37	37,42	-	172,35	-
Rumänien	II 2021	1,00	-	-	-	-	-	-	-	1,00	-
	II 2020	6,00	-	-	-	-	-	-	-	6,00	-
Deckungswerte Gesamt	II 2021	1,00	-	1,00	19,45	76,48	4,51	38,13	-	140,57	-
	II 2020	6,00	-	1,50	43,03	82,03	8,37	37,42	-	178,35	-

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten	II 2021	II 2020
§ 20 (2) Nr. 2 PfandBG	-	-

§ 28 (1) Nr. 4 und 5 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragene Forderungen	Stichtag	Ausgleichs-forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 1 PfandBG	Forderungen i. S. d. § 20 (2) Nr. 2 PfandBG - Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen *	Gesamt
	II 2021	-	-	-	-
	II 2020	-	-	-	-

* i. S. d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen auf Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
	II 2021	-	-	-	-	-
	II 2020	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
	II 2021	-	-	-	-	-
	II 2020	-	-	-	-	-