



I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs **)	30,00	25,00	31,54	27,03	27,51	23,47	36,45	31,34
Gesamtbetrag der Deckungsmassen **)	45,00	50,00	45,47	50,80	43,46	48,29	47,53	53,11
Überdeckung in %	50,00%	100,00%	44,17%	87,94%	57,98%	105,75%	30,40%	69,46%

	x ≤ 6 Monate		6 Monate < x ≤ 12 Monate		12 Monat < x ≤ 18 Monate		18 Monate < x ≤ 2 Jahre	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	0,00	5,00	5,00	10,00	10,00	0,00	10,00	5,00

	2 Jahre < x ≤ 3 Jahre		3 Jahre < x ≤ 4 Jahre		4 Jahre < x ≤ 5 Jahre		5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	10,00	0,00	0,00	10,00	5,00	0,00	15,00	15,00
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	20,00	20,00	0,00	10,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	10 Jahre < x	
	II 2021	II 2020
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	0,00	0,00
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	0,00	0,00

	II 2021		II 2020		Gesamtbetrag der Forderungen nach § 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Anteil der Derivategeschäfte an der Deckungsmasse nach § 28 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00				
Gesamtbetrag der Forderungen nach § 28 Abs. 1 Nr. 4 PfandBG	0,00	0,00				
Gesamtbetrag der Forderungen nach § 28 Abs. 1 Nr. 5 PfandBG***)	0,00	0,00			0,00	0,00
- davon Forderungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0,00	0,00			0,00	0,00

	II 2021		II 2020	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte an der Deckungsmasse	100,00	100,00		
prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	100,00	100,00		

\*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV  
\*\*) keine Fremdwährungen enthalten

\*\*\*) Staaten: ausschließlich Deutschland

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2021	II 2020
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	45,00	50,00

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	II 2021	II 2020
Ersatzdeckung		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG	0,0%	0,0%
davon die höchste Forderung	0,0%	0,0%

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen; geschuldet von	Staat <sup>1)</sup>	Regionale Gebietskörperschaften <sup>1)</sup>	Örtliche Gebietskörperschaften <sup>1)</sup>	Sonstige Schuldner <sup>1)</sup>
II 2021				
Deutschland	0,0	35,0	0	10,0
II 2020				
Deutschland****)	0,0	40,0	0	10,0

Zur Deckung verwendete Forderungen je Schuldner (in Mio. EUR; nennwertig) gem. § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG		
Stufe x ≤ 10	Stufe 10 < x ≤ 100	Stufe 100 < x
II 2021		
45	0	0
II 2020		
50	0	0

1) Keine Gewährleistung aus Gründen der Exportförderung  
Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen; gewährleistet von: liegen nicht vor

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2021	II 2020
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00
davon: Rückstand beträgt mindestens 5 % der Forderung	0,00	0,00

Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
II 2021				
Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
davon: Rückstand beträgt mindestens 5 % der Forderung	0,00	0,00	0,00	0,00
II 2020				
Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
davon: Rückstand beträgt mindestens 5 % der Forderung	0,00	0,00	0,00	0,00