



**I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur** (Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs **)	30,00	25,00	31,48	27,14	27,64	23,71	36,15	31,28
Gesamtbetrag der Deckungsmassen **)	50,00	45,00	50,16	45,56	48,14	43,36	52,30	47,57
Überdeckung in %	66,67%	80,00%	59,34%	67,87%	74,17%	82,88%	44,67%	52,08%

	x ≤ 6 Monate		6 Monate < x ≤ 12 Monate		12 Monate < x ≤ 18 Monate		18 Monate < x ≤ 2 Jahre	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	5,00	0,00	10,00	10,00	0,00	5,00	20,00	10,00

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

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

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

	III 2021		III 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      \*\*\*) Staaten: ausschließlich Deutschland  
\*\*) keine Fremdwährungen enthalten

**II) Zusammensetzung der Deckungsmasse** (Angaben in Mio. Euro)

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

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		III 2021	III 2020
<b>Ersatzdeckung</b>			
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>
III 2021				
Deutschland	0,0	40,0	0	10,0
III 2020				
Deutschland****)	0,0	35,0	0	10,00

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

	III 2021	III 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
III 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
III 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