



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 | Gesamtbetrag der Forderungen nach § 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG | |
|--|----------|----------|---|----------|
| | III 2021 | III 2020 | 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. 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 |

| | 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 | Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | |
|--|----------|----------|--|----------|
| | III 2021 | III 2020 | III 2021 | III 2020 |
| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | 50,00 | 45,00 | | |
| 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 ¹⁾ | Regionale Gebietskörperschaften ¹⁾ | Örtliche Gebietskörperschaften ¹⁾ | Sonstige Schuldner ¹⁾ |
|--|---------------------|---|--|----------------------------------|
| 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 |