

Stichtag	30.09.2021
Referenz	30.09.2020

## 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 *	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	227,54	238,84	238,51	255,85	238,51	226,68
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	236,90	256,05	259,04	286,21	259,04	254,10
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	4,11%	7,21%	8,61%	11,87%	8,61%	12,10%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
bis zu sechs Monate	14,84	12,30	20,75	23,29
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	16,88	16,04	19,63	11,56
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	5,76	15,60	10,85	18,26
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	9,29	16,82	13,69	19,51
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	26,94	17,13	16,57	26,90
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	19,73	26,71	26,25	16,60
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	22,14	19,47	24,68	25,46
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	90,42	101,76	92,90	99,45
über 10 Jahre	21,55	13,00	11,57	15,02

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.09.2021	30.09.2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	98,44%	98,67%
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	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

\* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

## II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	30.09.2021	30.09.2020
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	73,81	78,43
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	80,66	83,25
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	76,08	85,58
mehr als 10 Mio. €	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	30.09.2021	30.09.2020
wohnwirtschaftlich	84,01	89,45
gewerblich	146,53	157,80

Weitere Kennzahlen		30.09.2021	30.09.2020
§28 (1) Nr. 7 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) PfandBG überschreiten.	in Mio. EUR	0,00	0,00
§28 (1) Nr. 11 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning).	in Jahren	6,25	5,75
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	42,72%	43,65%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	230,55	247,25
Anteil am Gesamtumlauf	in %	101,32%	103,52%

nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)											
Staat	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	30.09.2021	17,05	32,59	34,38	0,00	0,31	0,00	146,23	0,00	0,00	230,55
	30.09.2020	14,58	36,59	36,98	0,00	0,42	0,00	157,39	0,00	1,30	247,25
<b>Summe</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>17,05</b>	<b>32,59</b>	<b>34,38</b>	<b>0,00</b>	<b>0,31</b>	<b>0,00</b>	<b>146,23</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>230,55</b>
	<b>30.09.2020</b>	<b>14,58</b>	<b>36,59</b>	<b>36,98</b>	<b>0,00</b>	<b>0,42</b>	<b>0,00</b>	<b>157,39</b>	<b>0,00</b>	<b>1,30</b>	<b>247,25</b>

### III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	30.09.21	30.09.20
§19 (1) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00
§19 (1) Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 4, 5 und 6 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 2 PfandBG				Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 3 PfandBG		Summe	
			Gesamt		davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
Staat	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	6,35	8,80	0,00	0,00	0,00	0,00	6,35	8,80
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6,35</b>	<b>8,80</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6,35</b>	<b>8,80</b>

### IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Stichtag	30.09.21
Referenz	30.09.20

## 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 *	
	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1,19	1,41	1,26	1,55	1,23	1,49
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %						

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20
bis zu sechs Monate	0,00	0,00	0,11	0,11
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,00	0,00	0,19	0,11
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	0,00	0,89	0,11
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,00	0,00	0,00	0,19
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	0,00	0,00	0,89
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,00	0,00	0,00	0,00
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	0,00	0,00	0,00
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,00	0,00	0,00	0,00
über 10 Jahre	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.09.2021	30.09.2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	100,00%	100,00%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		

§ 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	
	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

\* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

## II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs (nominal)	30.09.21		30.09.20	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Gesamte Deckungsmasse	1,19		1,41	
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	1,19		1,41	
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	0,00		0,00	
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	0,00		0,00	
davon Sichernde Überdeckung nach § 20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,00		0,00	

§28 (3) Nr.1 PfandBG Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	30.09.21	30.09.20
bis zu 10 Millionen €	1,19	1,41
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	0,00	0,00
mehr als 100 Millionen €	0,00	0,00

§28 (3) Nr. 2 Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen		Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		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	30.09.2021	0,00	0,00	1,19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,19	0,00
	30.09.2020	0,00	0,00	1,41	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,41	0,00
<b>DECKUNGS-WERTE, GESAMT</b>		30.09.2021	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1,19</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1,19</b>	<b>0,00</b>
		30.09.2020	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1,41</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1,41</b>	<b>0,00</b>

