

**Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe  
ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte**
**I) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG zum Gesamtbetrag (Angaben in Tsd. Euro)**

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten)	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	35.000	45.000	39.161	51.328	36.665	47.805	41.939	55.329
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	122.922	220.822	123.531	229.605	120.079	216.248	127.272	245.921
davon gattungsklassische Deckungswerte	112.922	195.822	113.513	204.023	111.048	193.761	116.130	216.722
davon sonstige Deckungswerte	10.000	25.000	10.018	25.582	9.031	22.487	11.143	29.199
Überdeckung in %	251,21%	390,72%	215,45%	347,33%	227,50%	352,35%	203,47%	344,47%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			25,58%					

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

**II) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)**

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
bis einschließlich 6 Monate	33.800	97.894	5.000	10.000	28.800	87.894
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	49.820	17.900	0	0	49.820	17.900
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	10.729	0	0	5.000	10.729	-5.000
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	10.850	24.700	0	0	10.850	24.700
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	7.724	9.895	10.000	0	-2.276	9.895
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	557	20.000	10.000	-20.000	-9.443
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	10.000	1.896	0	20.000	10.000	-18.104
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	0	28.148	0	0	0	28.148
über 10 Jahre	0	39.833	0	0	0	39.833

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

**III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)**

Weitere Deckung	Nennwert		Anteil am Pfandbriefumlauf		Überschreitung gesetzlicher Grenzen	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%	0	0
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%		
1. Halbsatz (10,00%)					0	0
2. Halbsatz (2,00%)					0	0

Weitere Deckung nach Ländern und Art der gesetzlichen Begrenzung	§ 20 Abs. 2 Nr. 2 ohne § 4 Abs. 1 Satz 2 Nr. 1 u. 2 PfandBG		davon Forderungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.12.21	30.12.20
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	100,00%

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

## Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

### IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 und 2 PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen	30.12.21	30.12.20
bis einschließlich 10 Mio.€	38.152	62.939
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	74.770	132.883
mehr als 100 Mio.€	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0	93.400	149.204	19.523	46.618

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0	93.400	149.204	19.523	46.618

	30.12.21	30.12.20
darunter ECA-Finanzierungen	0	0

### V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Tsd. Euro)

Rückständige Leistungen nach Ländern	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20	30.12.21	30.12.20
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

### Erläuterungen zu den im Report verwendeten Begriffen

Gattungsklassische Deckungswerte:	- Darlehnsforderungen oder Schuldverschreibungen nach § 20 Abs. 1 PfandBG
Sonstige Deckungswerte:	- weitere Deckungswerte nach § 20 Abs. 2 Nr. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG - sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG - Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG
Weitere Deckungswerte:	- nach § 20 Abs. 2 Nr. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG
Sichernde Überdeckung:	- nach § 4 Abs. 1 PfandBG