

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 Mio. Euro)

| | Nennwert | | Barwert | | Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben) | | Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten) | |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 45,0 | 55,0 | 46,6 | 57,3 | 42,0 | 51,5 | 51,9 | 64,3 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 87,6 | 90,0 | 98,6 | 103,8 | 87,6 | 91,3 | 112,4 | 119,7 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 75,6 | 80,0 | 85,9 | 93,1 | 75,9 | 81,7 | 98,5 | 107,6 |
| davon sonstige Deckungswerte | 12,0 | 10,0 | 12,7 | 10,7 | 11,7 | 9,6 | 13,9 | 12,1 |
| Überdeckung in % | 94,69% | 63,57% | 111,56% | 81,01% | 108,39% | 77,34% | 116,46% | 86,22% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 27,18% | | | | | |

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 Mio. Euro)

| | Deckungsmasse | | Pfandbriefumlauf | | Überhang | |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| bis einschließlich 6 Monate | 8,3 | 5,8 | 0,0 | 0,0 | 8,3 | 5,8 |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon. | 0,4 | 0,9 | 0,0 | 10,0 | 0,4 | -9,1 |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon. | 2,1 | 6,3 | 0,0 | 0,0 | 2,1 | 6,3 |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre | 3,8 | 0,4 | 10,0 | 0,0 | -6,2 | 0,4 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 8,7 | 6,2 | 0,0 | 10,0 | 8,7 | -3,8 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 4,5 | 7,2 | 20,0 | 0,0 | -15,5 | 7,2 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 9,4 | 4,9 | 0,0 | 20,0 | 9,4 | -15,1 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 26,2 | 23,2 | 15,0 | 15,0 | 11,2 | 8,2 |
| über 10 Jahre | 23,9 | 35,1 | 0,0 | 0,0 | 23,9 | 35,1 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

| Weitere Deckung | Nennwert | | Anteil am Pfandbriefumlauf | | Überschreitung gesetzlicher Grenzen | |
|--------------------------------|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG | 0,0 | 0,0 | 0,00% | 0,00% | 0,0 | 0,0 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG | 0,0 | 0,0 | 0,00% | 0,00% | | |
| 1. Halbsatz (10,00%) | | | | | 0,0 | 0,0 |
| 2. Halbsatz (2,00%) | | | | | 0,0 | 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 | |
|---|--|----------|---|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| | 30.06.21 | 30.06.20 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 100,00% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 97,42% | 97,43% |

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 Mio. Euro)

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Größenklassen | 30.06.21 | 30.06.20 |
|---|----------|----------|
| bis einschließlich 10 Mio.€ | 52,8 | 45,9 |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€ | 22,8 | 34,1 |
| mehr als 100 Mio.€ | 0,0 | 0,0 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 23,1 | 22,2 | 52,6 | 57,7 |

| Gattungsklassische Deckungswerte nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von - | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 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 | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 23,1 | 22,2 | 52,6 | 57,7 |

| | 30.06.21 | 30.06.20 |
|-----------------------------|----------|----------|
| darunter ECA-Finanzierungen | 0,0 | 0,0 |

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

| Rückständige Leistungen nach Ländern | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | | Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag | |
|--------------------------------------|--|----------|---|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |

| Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 | 30.06.21 | 30.06.20 |
| Deutschland | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 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 |