LIGA Bank eG

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

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	90,00	÷	89,70	÷	116,56	÷
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	148,16	÷	155,26	÷	174,45	÷
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	÷	0,00%	÷	0,00%	÷
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	÷	0,00%	÷	0,00%	÷
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	÷	0,00%	÷	0,00%	÷
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	÷	0,00%	÷	0,00%	÷
Überdeckung in %	64,62%	÷	73,09%	-	49,67%	-

§ 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	÷	7,93	÷
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,00	÷	11,61	÷
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	÷	30,77	÷
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,00	÷	17,24	÷
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	÷	13,41	÷
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,00	÷	8,57	÷
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	÷	10,27	÷
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	70,00	÷	32,83	÷
über 10 Jahre	20,00	÷	15,52	÷

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.09.2021	30.09.2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	100,00%	÷
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	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	
	30.09.21	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	÷

* 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	148,16	164,62%	÷	÷
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	148,16	164,62%	÷	÷
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	10,00	11,11%	÷	÷
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 €	104,84	÷
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	43,32	÷
mehr als 100 Millionen €	0,00	÷

§28 (3) Nr. 2 Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen Schuldnerklassen / Land		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		
Bundesrepublik Deutschland	30.09.2021	0,00	0,00	5,00	0,00	138,16	0,00	5,00	0,00	**148,16**	*0,00*
	30.09.2020	÷	÷	÷	÷	÷	÷	÷	÷	**0,00**	*0,00*
DECKUNGS-WERTE, GESAMT	30.09.2021	**0,00**	**0,00**	**5,00**	**0,00**	**138,16**	**0,00**	**5,00**	**0,00**	**148,16**	***0,00***
	30.09.2020	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	***0,00***

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
§20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,00	÷

§ 28 (1) Nr. 4 und 5 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen Staat	Ausgleichsforderungen i.S.d. §20 (2) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §20 (2) Nr. 2 PfandBG				**Summe**	
			Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013			
	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20	30.09.21	30.09.20
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		**Summe**	
	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**
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	**0,00**	**0,00**
Summe	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		**Summe**	
	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**
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	**0,00**	**0,00**
Summe	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**