

Stichtag	III 2020
Referenz	III 2019

**I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag**

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	235,00	245,00	263,59	279,02	239,45	248,93	292,22	315,06
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	832,28	812,81	951,12	933,73	822,89	809,23	1.109,21	1.086,70
davon gattungsklassische Deckungswerte	802,28	777,81	919,65	896,91	794,65	776,46	1.074,11	1.045,23
davon weitere Deckungswerte	30,00	35,00	31,46	36,82	28,24	32,77	35,10	41,46
Überdeckung in %	254,16%	231,76%	260,83%	234,64%	243,65%	225,08%	279,58%	244,91%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			4,00%					

**II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse**

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2020		Laufzeitstruktur III 2019		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2020	III 2019
bis zu sechs Monate	36,39	30,00	31,48	10,00	6,39	21,48
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	31,77	10,00	34,53	0,00	21,77	34,53
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	27,98	50,00	30,14	30,00	-22,02	0,14
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	32,67	10,00	32,56	10,00	22,67	22,56
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	68,34	20,00	63,03	60,00	48,34	3,03
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	74,93	15,00	72,17	20,00	59,93	52,17
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	92,87	10,00	75,15	15,00	82,87	60,15
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	304,53	70,00	332,30	70,00	234,53	262,30
über 10 Jahre	162,79	20,00	141,46	30,00	142,79	111,46

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) statistischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

**III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)**

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung nach	III 2020				III 2019				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		§19 Abs.1 Nr 3 PfandBG 20%-Grenze		Summe	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	30,00	35,00	30,00	35,00
<b>Summe</b>	-	-	-	-	<b>30,00</b>	<b>35,00</b>	<b>30,00</b>	<b>35,00</b>

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
keine	-	-	-	-	-	-

	III 2020	III 2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,00%	99,29%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,39%	54,40%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist( §13 Abs. 1 PfandBG )	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,91	4,70

Stichtag	III 2020
Referenz	III 2019

**IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse**

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	III 2020	III 2019	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	III 2020	III 2019	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
<b>nach Größenklassen</b>				<b>weitere Deckungswerte</b>			
bis einschließlich 300 T€	745,82	714,93		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	30,00	35,00	12,77%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	44,32	46,11		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	12,13	16,78		davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%
mehr als 10 Mio.€	-	-		Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-	0,00%
<b>nach Nutzungsart (I) in Deutschland</b>				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)			
wohnwirtschaftlich	774,56	745,42		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. la PfandBG	10,00	15,00	4,26%
gewerblich	27,72	32,40			20,00	20,00	8,51%
<b>nach Nutzungsart (II) in Deutschland</b>				<b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>			
Eigentumswohnungen	109,84	104,74	13,20%		832,28	812,81	354,16%
Ein- und Zweifamilienhäuser	563,18	536,98	67,67%				
Mehrfamilienhäuser	101,54	103,70	12,20%				
Bürogebäude	3,56	5,50	0,43%				
Handelsgebäude	0,48	0,77	0,06%				
Industriegebäude	13,45	15,69	1,62%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	10,23	10,44	1,23%				
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%				
Bauplätze	-	-	0,00%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

**V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 2 Nr. 2**

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
Bundesrepublik Deutschland	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>