

| | |
|----------|--------|
| Stichtag | I 2021 |
| Referenz | I 2020 |

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) | |
|--|----------|---------|---------|---------|--|---------|---|----------|
| | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 205,00 | 235,00 | 226,75 | 262,68 | 205,62 | 235,91 | 251,68 | 294,55 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmassen | 849,47 | 827,50 | 952,54 | 938,82 | 824,61 | 813,40 | 1.110,32 | 1.093,18 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 819,47 | 792,50 | 921,28 | 902,35 | 796,20 | 780,53 | 1.075,87 | 1.052,61 |
| davon weitere Deckungswerte | 30,00 | 35,00 | 31,27 | 36,48 | 28,41 | 32,87 | 34,45 | 40,57 |
| Überdeckung in % | 314,38% | 252,13% | 320,09% | 257,41% | 301,03% | 244,79% | 341,17% | 271,14% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 4,61% | | | | | |

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

(Angaben in Mio. Euro)

| | Laufzeitstruktur I 2021 | | Laufzeitstruktur I 2020 | | Überhang | |
|--|-------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|----------|--------|
| | Deckungs- masse | Pfandbrief- umlauf | Deckungs- masse | Pfandbrief- umlauf | I 2021 | I 2020 |
| bis zu sechs Monate | 40,62 | 10,00 | 39,28 | 0,00 | 30,62 | 39,28 |
| mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten | 27,32 | 50,00 | 28,19 | 30,00 | -22,68 | -1,81 |
| mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten | 32,23 | 10,00 | 31,85 | 10,00 | 22,23 | 21,85 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 35,19 | 20,00 | 29,36 | 50,00 | 15,19 | -20,64 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 66,78 | 15,00 | 69,66 | 30,00 | 51,78 | 39,66 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 87,60 | 0,00 | 67,98 | 15,00 | 87,60 | 52,98 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 74,22 | 20,00 | 90,47 | 0,00 | 54,22 | 90,47 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 309,78 | 80,00 | 318,44 | 80,00 | 229,78 | 238,44 |
| über 10 Jahre | 175,73 | 0,00 | 152,27 | 20,00 | 175,73 | 132,27 |

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 | I 2021 | | | | I 2020 | | | | 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 | |
|--|-------------------------------------|--------|---|--------|-----------------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 |
| Bundesrepublik Deutschland | - | - | - | - | 30,00 | 35,00 | 30,00 | 35,00 |
| Summe | - | - | - | - | 30,00 | 35,00 | 30,00 | 35,00 |

| Nettobarwert je Fremdwährung | Barwert der Deckungsmassen | | Barwert des Pfandbriefumlaufs | | Nettobarwert in Fremdwährung | |
|------------------------------|----------------------------|--------|-------------------------------|--------|------------------------------|--------|
| | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 |
| keine | - | - | - | - | - | - |

| | I 2021 | I 2020 |
|--|---------|---------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 98,71% | 99,27% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 100,00% |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | 54,43% | 54,40% |
| Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG) | - | - |
| volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit | 4,94 | 4,79 |

| | |
|----------|--------|
| Stichtag | I 2021 |
| Referenz | I 2020 |

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

(Angaben in Mio. Euro)

| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | I 2021 | I 2020 | Anteil am Gesamtbeitrag der Deckungsmasse | Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung) | I 2021 | I 2020 | Anteil am Gesamtbeitrag des Pfandbriefumlaufs |
|--|--------|--------|---|--|---------------|---------------|---|
| nach Größenklassen | | | | weitere Deckungswerte | | | |
| bis einschließlich 300 T€ | 760,40 | 735,42 | | weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto | 30,00 | 35,00 | 14,63% |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€ | 46,98 | 45,87 | | davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG | - | - | 0,00% |
| mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€ | 12,09 | 11,21 | | davon höchste Geldforderung geg. KI | - | - | 0,00% |
| mehr als 10 Mio.€ | - | - | | Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG | - | - | 0,00% |
| nach Nutzungsart (I) in Deutschland | | | | Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet) | 10,00 | 15,00 | 4,88% |
| wohnwirtschaftlich | 793,38 | 763,15 | | Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG | 20,00 | 20,00 | 9,76% |
| gewerblich | 26,09 | 29,35 | | Summe gattungsklassische und weitere Deckung | 849,47 | 827,50 | 414,38% |
| nach Nutzungsart (II) in Deutschland | | | | | | | |
| Eigentumswohnungen | 112,27 | 108,47 | 13,22% | | | | |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 580,03 | 552,52 | 68,28% | | | | |
| Mehrfamilienhäuser | 101,08 | 102,17 | 11,90% | | | | |
| Bürogebäude | 3,45 | 3,60 | 0,41% | | | | |
| Handelsgebäude | 0,36 | 0,62 | 0,04% | | | | |
| Industriegebäude | 11,89 | 14,92 | 1,40% | | | | |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 10,39 | 10,21 | 1,22% | | | | |
| 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% Rückstandsbeitrag | |
|----------------------------|--|-------------|---|-------------|
| | I 2021 | I 2020 | I 2021 | I 2020 |
| Bundesrepublik Deutschland | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Summe | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |