

Stichtag	I 2020
Referenz	I 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)	
	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	235,00	240,00	262,68	268,20	235,91	238,35	294,55	303,98
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	827,50	778,64	938,82	872,31	813,40	758,46	1.093,18	1.011,53
davon gattungsklassische Deckungswerte	792,50	743,64	902,35	836,08	780,53	726,57	1.052,61	970,27
davon weitere Deckungswerte	35,00	35,00	36,48	36,23	32,87	31,89	40,57	41,26
Überdeckung in %	252,13%	224,43%	257,41%	225,24%	244,79%	218,21%	271,14%	232,76%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,92%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2020		Laufzeitstruktur I 2019		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2020	I 2019
bis zu sechs Monate	39,28	0,00	24,36	5,00	39,28	19,36
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	28,19	30,00	27,78	10,00	-1,81	17,78
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	31,85	10,00	35,45	0,00	21,85	35,45
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	29,36	50,00	32,30	30,00	-20,64	2,30
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	69,66	30,00	62,84	60,00	39,66	2,84
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	67,98	15,00	71,82	30,00	52,98	41,82
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	90,47	0,00	66,92	15,00	90,47	51,92
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	318,44	80,00	330,34	60,00	238,44	270,34
über 10 Jahre	152,27	20,00	126,82	30,00	132,27	96,82

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 2020				I 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	
	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	35,00	35,00	35,00	35,00
Summe	-	-	-	-	35,00	35,00	35,00	35,00

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

	I 2020	I 2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	99,27%	99,27%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	97,92%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,40%	54,33%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,79	4,59

Stichtag	I 2020
Referenz	I 2019

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2020	I 2019	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	I 2020	I 2019	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	735,42	679,53		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	35,00	14,89%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	45,87	47,23		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	11,21	16,88		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)			
wohnwirtschaftlich	763,15	707,96		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. la PfandBG	15,00	15,00	6,38%
gewerblich	29,35	35,67			20,00	20,00	8,51%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung			
Eigentumswohnungen	108,47	99,07	13,11%		827,50	778,64	352,13%
Ein- und Zweifamilienhäuser	552,52	510,18	66,77%				
Mehrfamilienhäuser	102,17	98,71	12,35%				
Bürogebäude	3,60	5,71	0,43%				
Handelsgebäude	0,62	1,44	0,08%				
Industriegebäude	14,92	17,81	1,80%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	10,21	10,72	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	
	I 2020	I 2019	I 2020	I 2019
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00