

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) | |
|--|------------|------------|------------|------------|--|------------|---|------------|
| | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 695,00 | 490,00 | 755,76 | 503,50 | 637,90 | 425,34 | 898,74 | 599,19 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 938,74 | 689,61 | 1.065,01 | 748,42 | 917,78 | 651,61 | 1.248,21 | 868,32 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 879,14 | 650,11 | 999,77 | 708,89 | 867,83 | 620,22 | 1.161,63 | 818,04 |
| davon weitere Deckungswerte | 59,50 | 39,50 | 65,24 | 39,53 | 49,95 | 31,39 | 86,58 | 50,28 |
| Überdeckung in % | 35,07% | 40,74% | 40,92% | 48,64% | 43,87% | 53,20% | 38,88% | 44,92% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in % | | | 8,63% | 7,85% | | | | |

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

| | Deckungsmasse | | Pfandbriefumlauf | | Überhang | |
|--------------------------------------|---------------|------------|------------------|------------|------------|------------|
| | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
| bis zu 6 Monate | 54,55 | 35,89 | - | - | 54,55 | 35,89 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 20,30 | 19,25 | - | - | 20,30 | 19,25 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 31,82 | 14,98 | - | - | 31,82 | 14,98 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 32,88 | 16,94 | 10,00 | - | 22,88 | 16,94 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 67,63 | 63,23 | 40,00 | 10,00 | 27,63 | 53,23 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 71,90 | 60,13 | 45,00 | 40,00 | 26,90 | 20,13 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 88,60 | 60,21 | 60,00 | 45,00 | 28,60 | 15,21 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 392,01 | 309,84 | 540,00 | 395,00 | -147,99 | -85,16 |
| über 10 Jahre | 179,04 | 109,15 | - | - | 179,04 | 109,15 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statisches Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse) (Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

| Weitere Deckung nach | 30.09.2019 | | | | 30.09.2018 | | | | gesetzl. Grenze |
|--------------------------|--------------------|-------------------------|-------------------|------------------|--------------------|-------------------------|-------------------|------------------|-----------------|
| | Nominalwert brutto | davon nicht anrechenbar | Nominalwert netto | Anteil am Umlauf | Nominalwert brutto | davon nicht anrechenbar | Nominalwert netto | Anteil am Umlauf | |
| §19 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| §19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG | - | - | - | - | - | - | - | - | 10,00% |
| §19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG | - | - | - | - | - | - | - | - | 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 | |
|---|--|------------|---|------------|--------------------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
| Bundesrepublik Deutschland | - | - | - | - | 53,50 | 33,50 | 53,50 | 33,50 |
| Osterreich | - | - | - | - | 6,00 | 6,00 | 6,00 | 6,00 |
| EU-Institutionen | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Summe | - | - | - | - | 59,50 | 39,50 | 59,50 | 39,50 |

*) Die Tabelle enthält Nominalwerte der weiteren Deckungswerte inklusive der sichernden Überdeckung und der Liquiditätssicherung.

| Nettobarwert je Fremdwährung | Barwert der Deckungsmassen | | Barwert des Pfandbriefumlaufs | | Nettobarwert in Fremdwährung | |
|------------------------------|-------------------------------|------------|----------------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
| keine | - | - | - | - | - | - |

| | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
|--|------------|------------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 97,26% | 97,74% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 100,00% |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | 55,61% | 55,33% |
| Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG) | - | - |
| volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren) | 4,38 | 4,39 |

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

| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | 30.09.2019 | | 30.09.2018 | | Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse |
|--|------------|------------|------------|------------|--|
| | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 | |
| | | | | | |

| nach Größenklassen | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
|--|------------|------------|
| bis einschließlich 300 T€ | 622,28 | 454,84 |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€ | 98,12 | 79,61 |
| mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€ | 123,76 | 105,07 |
| mehr als 10 Mio.€ | 35,08 | 10,60 |

| nach Nutzungsart (I) in Deutschland | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
|-------------------------------------|------------|------------|
| wohnwirtschaftlich | 712,42 | 531,45 |
| gewerblich | 166,82 | 118,66 |

| nach Nutzungsart (II) in Deutschland | 30.09.2019 | 30.09.2018 | Anteil |
|--|------------|------------|--------|
| Eigentumswohnungen | 202,66 | 131,26 | 21,59% |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 420,97 | 321,33 | 44,84% |
| Mehrfamilienhäuser | 88,78 | 78,86 | 9,46% |
| Bürogebäude | 18,86 | 18,12 | 2,01% |
| Handelsgebäude | 40,18 | 11,09 | 4,28% |
| Industriegebäude | 61,12 | 67,36 | 6,51% |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 46,65 | 22,09 | 4,97% |
| unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten | - | - | 0,00% |
| Bauplätze | - | - | 0,00% |

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

| weitere Deckungswerte | 30.09.2019 | 30.09.2018 | Anteil |
|--|---------------|---------------|----------------|
| weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto | 59,50 | 39,50 | 8,56% |
| davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG | - | - | 0,00% |
| davon höchste Geldforderung geg. KI | - | - | 0,00% |
| Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG | - | 39,50 | 0,00% |
| Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet) | 59,50 | 39,50 | 8,56% |
| Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG | - | - | 0,00% |
| Summe gattungsklassische und weitere Deckung | 938,74 | 690,61 | 135,07% |

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 | |
|--------------|--|------------|--|------------|
| | 30.09.2019 | 30.09.2018 | 30.09.2019 | 30.09.2018 |
| keine | - | - | - | - |
| Summe | - | - | - | - |