

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)	
	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	765,00	745,00	809,86	795,91	702,15	675,74	937,66	941,06
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	1.153,67	1.005,22	1.278,11	1.126,45	1.108,92	972,21	1.487,69	1.318,15
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.094,17	945,72	1.214,70	1.062,02	1.058,64	922,35	1.406,50	1.233,59
davon weitere Deckungswerte	59,50	59,50	63,41	64,43	50,28	49,86	81,19	84,57
Überdeckung in %	50,81%	34,93%	57,82%	41,53%	57,93%	43,87%	58,66%	40,07%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,83%	8,09%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020
bis zu 6 Monate	91,85	57,45	10,00	-	81,85	57,45
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	37,92	32,94	20,00	-	17,92	32,94
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	36,81	33,55	20,00	10,00	16,81	23,55
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	43,01	36,05	25,00	20,00	18,01	16,05
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	75,29	76,42	50,00	45,00	25,29	31,42
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	118,29	71,36	60,00	50,00	58,29	21,36
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	123,94	115,40	45,00	60,00	78,94	55,40
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	391,16	392,22	535,00	560,00	-143,84	-167,78
über 10 Jahre	235,41	189,83	-	-	235,41	189,83

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)

	31.03.2021				31.03.2020				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
Weitere Deckung nach §19 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%
§19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG	-	-	-	-	-	-	-	-	

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung ^{a)}	§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	
	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	53,50	53,50	53,50	53,50
Österreich	-	-	-	-	6,00	6,00	6,00	6,00
EU-Institutionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-	59,50	59,50	59,50	59,50

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

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmasse		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020
keine	-	-	-	-	-	-

	31.03.2021	31.03.2020
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,20%	97,25%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,43%	55,38%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,75	4,49

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse		Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	
	31.03.2021	31.03.2020		31.03.2021	31.03.2020
nach Größenklassen					
bis einschließlich 300 T€	779,14	682,14			
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	136,33	104,66			
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	131,03	123,83			
mehr als 10 Mio.€	47,67	35,08			
nach Nutzungsart (I) in Deutschland					
wohnwirtschaftlich	907,10	780,38			
gewerblich	187,07	165,33			
nach Nutzungsart (II) in Deutschland					
Eigentumswohnungen	302,27	231,23			26,20%
Ein- und Zweifamilienhäuser	508,24	454,42			44,05%
Mehrfamilienhäuser	96,59	94,74			8,37%
Bürogebäude	27,50	18,49			2,38%
Handelsgebäude	41,17	40,18			3,57%
Industriegebäude	65,55	58,66			5,68%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	52,85	48,00			4,58%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-			0,00%
Bauplätze	-	-			0,00%
Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.					
weitere Deckungswerte	59,50	59,50			7,78%
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-			0,00%
davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-			0,00%
davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-			0,00%
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	-	-			0,00%
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	59,50	59,50			7,78%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-			0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	1.153,67	1.005,22			150,81%

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	
	31.03.2021	31.03.2020	31.03.2021	31.03.2020
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-