

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) | |
|--|------------|------------|------------|------------|--|------------|---|------------|
| | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 695,00 | 550,00 | 742,00 | 571,57 | 630,11 | 482,17 | 876,99 | 679,88 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 953,61 | 750,41 | 1.063,63 | 820,15 | 919,13 | 713,28 | 1.243,01 | 950,93 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 894,11 | 710,91 | 1.000,39 | 779,95 | 870,37 | 681,14 | 1.159,73 | 900,30 |
| davon weitere Deckungswerte | 59,50 | 39,50 | 63,23 | 40,20 | 48,76 | 32,15 | 83,28 | 50,63 |
| Überdeckung in % | 37,21% | 36,44% | 43,35% | 43,49% | 45,87% | 47,93% | 41,74% | 39,87% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 8,52% | 7,03% | | | | |

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

| | Deckungsmasse | | Pfandbriefumlauf | | Überhang | |
|--------------------------------------|---------------|------------|------------------|------------|------------|------------|
| | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 |
| bis zu 6 Monate | 56,05 | 41,29 | - | - | 56,05 | 41,29 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 25,94 | 16,27 | - | - | 25,94 | 16,27 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 33,38 | 17,55 | - | - | 33,38 | 17,55 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 37,03 | 25,49 | 20,00 | - | 17,03 | 25,49 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 71,70 | 63,34 | 40,00 | 20,00 | 31,70 | 43,34 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 76,29 | 69,80 | 55,00 | 40,00 | 21,29 | 29,80 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 99,10 | 69,75 | 60,00 | 55,00 | 39,10 | 14,75 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 371,77 | 320,10 | 520,00 | 435,00 | -148,23 | -114,90 |
| über 10 Jahre | 182,34 | 126,82 | - | - | 182,34 | 126,82 |

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 | 31.12.2019 | | | | 31.12.2018 | | | | 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 | |
|---|--|------------|---|------------|--------------------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 |
| 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 Deckungsmasse | | Barwert des Pfandbriefumlaufs | | Nettobarwert in Fremdwährung | |
|------------------------------|------------------------------|------------|----------------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 |
| keine | - | - | - | - | - | - |

| | 31.12.2019 | 31.12.2018 |
|--|------------|------------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte | 97,18% | 97,73% |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 100,00% | 100,00% |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | 55,40% | 55,39% |
| Überschreitungsbeitrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG) | - | - |
| volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren) | 4,50 | 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 | 31.12.2019 | | 31.12.2018 | | Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse | Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung) | 31.12.2019 | | 31.12.2018 | | Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs |
|--|------------|--------|------------|--|--|--|---------------|---------------|----------------|--|--|
| | | | | | | | | | | | |
| nach Größenklassen | | | | | | weitere Deckungswerte | 59,50 | 39,50 | 8,56% | | |
| bis einschließlich 300 T€ | 640,29 | 502,80 | | | | weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto | - | - | 0,00% | | |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€ | 100,00 | 86,47 | | | | davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG | - | - | 0,00% | | |
| mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€ | 118,75 | 111,04 | | | | davon höchste Geldforderung geg. KI | - | - | 0,00% | | |
| mehr als 10 Mio.€ | 35,08 | 10,60 | | | | Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG | - | - | 0,00% | | |
| nach Nutzungsart (I) in Deutschland | | | | | | Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet) | 59,50 | 39,50 | 8,56% | | |
| wohnwirtschaftlich | 732,37 | 586,68 | | | | Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG | - | - | 0,00% | | |
| gewerblich | 161,75 | 124,23 | | | | Summe gattungsklassische und weitere Deckung | 953,61 | 750,41 | 137,21% | | |
| nach Nutzungsart (II) in Deutschland | | | | | | | | | | | |
| Eigentumswohnungen | 212,97 | 145,82 | 22,33% | | | | | | | | |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 429,60 | 354,49 | 45,05% | | | | | | | | |
| Mehrfamilienhäuser | 89,79 | 86,38 | 9,42% | | | | | | | | |
| Bürogebäude | 18,70 | 17,55 | 1,96% | | | | | | | | |
| Handelsgebäude | 40,18 | 11,09 | 4,21% | | | | | | | | |
| Industriegebäude | 55,09 | 67,55 | 5,78% | | | | | | | | |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 47,78 | 28,03 | 5,01% | | | | | | | | |
| unfertige und noch 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 | |
|--------------|--|------------|--|------------|
| | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 |
| keine | - | - | - | - |
| Summe | - | - | - | - |