

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)	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	765,00	745,00	806,54	801,22	703,45	684,07	928,24	941,98
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	1.215,36	1.047,29	1.339,97	1.179,80	1.163,05	1.019,24	1.558,64	1.379,29
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.155,86	987,79	1.276,81	1.114,53	1.112,69	968,50	1.478,21	1.293,99
davon weitere Deckungswerte	59,50	59,50	63,17	65,28	50,36	50,74	80,43	85,29
Überdeckung in %	58,87%	40,58%	66,14%	47,25%	65,33%	49,00%	67,91%	46,42%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,83%	8,15%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
bis zu 6 Monate	84,87	65,28	20,00	-	64,87	65,28
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	39,98	36,27	20,00	-	19,98	36,27
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	41,11	32,76	20,00	20,00	21,11	12,76
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	43,88	38,70	25,00	20,00	18,88	18,70
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	84,72	82,39	50,00	45,00	34,72	37,39
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	142,59	80,72	50,00	50,00	92,59	30,72
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	128,54	123,74	75,00	50,00	53,54	73,74
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	399,66	389,15	505,00	560,00	-105,34	-170,85
über 10 Jahre	250,01	198,29	-	-	250,01	198,29

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)

	30.06.2021				30.06.2020				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	-	-	-	-	-	-	-	-	20,00%

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	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
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

^{a)} 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	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
keine	-	-	-	-	-	-

	30.06.2021	30.06.2020
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,86%	97,16%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,57%	55,40%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,84	4,57

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.06.2021		30.06.2020		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	30.06.2021		30.06.2020		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen							59,50	59,50	7,78%		
bis einschließlich 300 T€	801,73	712,29				weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-	0,00%		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	143,89	114,72				davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	-	-	0,00%		
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	132,58	125,70				davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%		
mehr als 10 Mio.€	77,66	35,08				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	59,50	7,78%		
wohnwirtschaftlich	951,39	818,16				Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%		
gewerblich	204,47	169,63				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	1.215,36	1.047,29	158,87%		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	318,66	245,83	26,22%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	519,42	474,01	42,74%								
Mehrfamilienhäuser	113,30	98,32	9,32%								
Bürogebäude	43,11	20,35	3,55%								
Handelsgebäude	40,92	40,18	3,37%								
Industriegebäude	68,50	60,83	5,64%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	51,93	48,28	4,27%								
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	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-