

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)	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	745,00	695,00	802,85	755,76	689,47	637,90	938,36	898,74
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	1.089,19	938,74	1.229,28	1.065,01	1.063,69	917,78	1.434,92	1.248,21
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.029,69	879,14	1.163,72	999,77	1.012,45	867,83	1.349,72	1.161,63
davon weitere Deckungswerte	59,50	59,50	65,56	65,24	51,24	49,95	85,20	86,58
Überdeckung in %	46,20%	35,07%	53,11%	40,92%	54,28%	43,87%	52,92%	38,88%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			8,17%	8,63%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
bis zu 6 Monate	81,37	54,55	-	-	81,37	54,55
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	34,30	20,30	10,00	-	24,30	20,30
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	36,86	31,82	20,00	-	16,86	31,82
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	36,83	32,88	20,00	10,00	16,83	22,88
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	73,91	67,63	45,00	40,00	28,91	27,63
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	97,71	71,90	60,00	45,00	37,71	26,90
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	118,95	88,60	55,00	60,00	63,95	28,60
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	398,27	392,01	535,00	540,00	-136,73	-147,99
über 10 Jahre	210,99	179,04	-	-	210,99	179,04

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	30.09.2020				30.09.2019				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	-	-	-	-	-	-	-	-	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	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
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	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
keine	-	-	-	-	-	-

	30.09.2020	30.09.2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,53%	97,26%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,39%	55,61%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,66	4,38

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.09.2020		30.09.2019		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	30.09.2020		30.09.2019		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen							59,50	59,50	7,99%		
bis einschließlich 300 T€	734,40	622,28				weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-	0,00%		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	120,95	98,12				davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%		
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	139,26	123,76				davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%		
mehr als 10 Mio.€	35,08	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	7,99%		
wohnwirtschaftlich	843,35	712,42				Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%		
gewerblich	186,34	166,82				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	1.089,19	938,74	146,20%		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	258,00	202,66	23,69%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	486,14	420,97	44,63%								
Mehrfamilienhäuser	99,22	88,78	9,11%								
Bürogebäude	27,05	18,86	2,48%								
Handelsgebäude	40,18	40,18	3,69%								
Industriegebäude	64,87	61,12	5,96%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	54,24	46,65	4,98%								
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	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-