

**I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag** (Angaben in Mio. Euro)

|  | Nennwert   |            | Barwert    |            | Risikobarwert *)<br>(Verschieb. nach oben) |            | Risikobarwert *)<br>(Verschieb. nach unten) |            |
|--|------------|------------|------------|------------|--|------------|---|------------|
|  | 30.09.2021 | 30.09.2020 | 30.09.2021 | 30.09.2020 | 30.09.2021                                 | 30.09.2020 | 30.09.2021                                  | 30.09.2020 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs                 | 755,00     | 745,00     | 792,63     | 802,85     | 694,29                                     | 689,47     | 908,15                                      | 938,36     |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse                     | 1.246,17   | 1.089,19   | 1.367,18   | 1.229,28   | 1.186,14                                   | 1.063,69   | 1.591,16                                    | 1.434,92   |
| davon gattungsklassische Deckungswerte             | 1.186,67   | 1.029,69   | 1.304,35   | 1.163,72   | 1.135,75                                   | 1.012,45   | 1.511,62                                    | 1.349,72   |
| davon weitere Deckungswerte                        | 59,50      | 59,50      | 62,84      | 65,56      | 50,39                                      | 51,24      | 79,54                                       | 85,20      |
| Überdeckung in %                                   | 65,06%     | 46,20%     | 72,49%     | 53,11%     | 70,84%                                     | 54,26%     | 75,21%                                      | 52,92%     |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % |            |            | 7,93%      | 8,17%      |  |            |   |            |

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

|                                      | Deckungsmasse |            | Pfandbriefumlauf |            | Überhang   |            |
|--------------------------------------|---------------|------------|------------------|------------|------------|------------|
|                                      | 30.09.2021    | 30.09.2020 | 30.09.2021       | 30.09.2020 | 30.09.2021 | 30.09.2020 |
| bis zu 6 Monate                      | 88,58         | 81,37      | 20,00            | -          | 68,58      | 81,37      |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten  | 37,02         | 34,30      | 20,00            | 10,00      | 17,02      | 24,30      |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 44,15         | 36,86      | 25,00            | 20,00      | 19,15      | 16,86      |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren   | 32,53         | 36,83      | 20,00            | 20,00      | 12,53      | 16,83      |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren     | 99,55         | 73,91      | 60,00            | 45,00      | 39,55      | 28,91      |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren     | 139,80        | 97,71      | 55,00            | 60,00      | 84,80      | 37,71      |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren     | 131,67        | 118,95     | 85,00            | 55,00      | 46,67      | 63,95      |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren    | 409,06        | 398,27     | 470,00           | 535,00     | -60,94     | -136,73    |
| über 10 Jahre                        | 263,80        | 210,99     | -                | -          | 263,80     | 210,99     |

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     | 30.09.2021         |                         |                   |                  | 30.09.2020         |                         |                   |                  | 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 <sup>a)</sup> | §19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG<br>10%-Grenze |            | davon gedeckte<br>Schuldverschreibungen<br>i.S.d. Artikels 129<br>Verordnung (EU) Nr.<br>575/2013 |            | §19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG<br>20%-Grenze |              | Summe        |              |
|--|--|------------|---|------------|--|--------------|--------------|--------------|
|  | 30.09.2021                             | 30.09.2020 | 30.09.2021  | 30.09.2020 | 30.09.2021                             | 30.09.2020   | 30.09.2021   | 30.09.2020   |
| Bundesrepublik Deutschland                                     | -                                      | -          | -   | -          | 53,50                                  | 53,50        | 53,50        | 53,50        |
| Österreich   | -                                      | -          | -   | -          | 6,00                                   | 6,00         | 6,00         | 6,00         |
| EU-Institutionen   | -                                      | -          | -   | -          | -                                      | -            | -            | -            |
| <b>Summe</b>   | -                                      | -          | -   | -          | <b>59,50</b>                           | <b>59,50</b> | <b>59,50</b> | <b>59,50</b> |

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

| Nettobarwert je Fremdwährung | Barwert der<br>Deckungsmasse |            | Barwert des<br>Pfandbriefumlaufs |            | Nettobarwert in<br>Fremdwährung |            |
|------------------------------|------------------------------|------------|----------------------------------|------------|---------------------------------|------------|
|                              | 30.09.2021                   | 30.09.2020 | 30.09.2021                       | 30.09.2020 | 30.09.2021                      | 30.09.2020 |
| keine                        | -                            | -          | -                                | -          | -                               | -          |

|   | 30.09.2021 | 30.09.2020 |
|---|------------|------------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte   | 96,99%     | 96,53%     |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe   | 100,00%    | 100,00%    |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf  | 55,61%     | 55,39%     |
| Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG) | -          | -          |
| volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)   | 4,89       | 4,66       |

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

| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | 30.09.2021 |        | 30.09.2020 |  | Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse | Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)   | 30.09.2021      |                 | 30.09.2020     |  | Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs |
|--|------------|--------|------------|--|--|--|-----------------|-----------------|----------------|--|--|
|  |            |        |            |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| nach Größenklassen                                   |            |        |            |  |  |  | 59,50           | 59,50           | 7,88%          |  |  |
| bis einschließlich 300 T€                            | 822,19     | 734,40 |            |  |  | weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto                       | -               | -               | 0,00%          |  |  |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€           | 152,11     | 120,95 |            |  |  | davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG  | -               | -               | 0,00%          |  |  |
| mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€         | 134,71     | 139,26 |            |  |  | 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           | 7,88%          |  |  |
| wohnwirtschaftlich                                   | 979,72     | 843,35 |            |  |  | Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG | -               | -               | 0,00%          |  |  |
| gewerblich   | 206,95     | 186,34 |            |  |  | <b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>                      | <b>1.246,17</b> | <b>1.089,19</b> | <b>165,06%</b> |  |  |
| nach Nutzungsart (II) in Deutschland                 |            |        |            |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| Eigentumswohnungen                                   | 332,32     | 258,00 | 26,67%     |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| Ein- und Zweifamilienhäuser                          | 530,75     | 486,14 | 42,59%     |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| Mehrfamilienhäuser                                   | 116,66     | 99,22  | 9,36%      |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| Bürogebäude  | 45,73      | 27,05  | 3,67%      |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| Handelsgebäude                                       | 40,90      | 40,18  | 3,28%      |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| Industriegebäude                                     | 68,11      | 64,87  | 5,47%      |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude                 | 52,21      | 54,24  | 4,19%      |  |  |  |                 |                 |                |  |  |
| 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% Rückstandsbeitrag |            |
|--------------|--|------------|---|------------|
|              | 30.09.2021                                 | 30.09.2020 | 30.09.2021                                      | 30.09.2020 |
| keine        | -  | -          | -   | -          |
| <b>Summe</b> | -  | -          | -   | -          |