

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)	
	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	745,00	630,00	795,91	665,67	675,74	559,47	941,06	794,95
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	1.005,22	836,68	1.126,45	925,54	972,21	801,13	1.318,15	1.078,50
davon gattungsklassische Deckungswerte	945,72	787,18	1.062,02	873,55	922,35	760,26	1.233,59	1.011,78
davon weitere Deckungswerte	59,50	49,50	64,43	51,99	49,86	40,87	84,57	66,72
Überdeckung in %	34,93%	32,81%	41,53%	39,04%	43,87%	43,19%	40,07%	35,67%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			8,09%	7,81%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019
bis zu 6 Monate	57,45	48,74	-	-	57,45	48,74
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	32,94	17,24	-	-	32,94	17,24
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	33,55	19,33	10,00	-	23,55	19,33
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	36,05	30,29	20,00	-	16,05	30,29
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	76,42	65,89	45,00	30,00	31,42	35,89
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	71,36	69,76	50,00	45,00	21,36	24,76
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	115,40	66,31	60,00	50,00	55,40	16,31
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	392,22	366,54	560,00	505,00	-167,78	-138,46
über 10 Jahre	189,83	152,58	-	-	189,83	152,58

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	31.03.2020				31.03.2019				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	
	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	53,50	43,50	53,50	43,50
Österreich	-	-	-	-	6,00	6,00	6,00	6,00
EU-Institutionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-	59,50	49,50	59,50	49,50

*) 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	
	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019
keine	-	-	-	-	-	-

	31.03.2020	31.03.2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,25%	97,74%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,38%	55,46%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit (in Jahren)	4,49	4,31

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	31.03.2020		31.03.2019		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	31.03.2020		31.03.2019		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen											
bis einschließlich 300 T€	682,14	546,11									
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	104,66	89,27									
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	123,83	116,72									
mehr als 10 Mio.€	35,08	35,08									
nach Nutzungsart (I) in Deutschland											
wohnwirtschaftlich	780,38	632,47									
gewerblich	165,33	154,71									
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	231,23	168,30	23,00%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	454,42	378,56	45,21%								
Mehrfamilienhäuser	94,74	85,61	9,42%								
Bürogebäude	18,49	17,74	1,84%								
Handelsgebäude	40,18	35,57	4,00%								
Industriegebäude	58,66	58,04	5,84%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	48,00	43,35	4,78%								
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%								
Bauplätze	-	-	0,00%								
Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.											
weitere Deckungswerte	59,50	49,50	7,99%								
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	49,50	7,99%								
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%								
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	1.005,22	836,68	134,93%								

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	
	31.03.2020	31.03.2019	31.03.2020	31.03.2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-