

**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	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-	<b>59,50</b>	<b>39,50</b>	<b>59,50</b>	<b>39,50</b>

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

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		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				<b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>	<b>953,61</b>	<b>750,41</b>	<b>137,21%</b>		
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	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-