

**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)	
	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	745,00	695,00	801,90	742,00	692,73	630,11	931,70	876,99
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	1.122,94	953,61	1.265,73	1.063,63	1.097,11	919,13	1.474,75	1.243,01
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.063,44	894,11	1.200,14	1.000,39	1.045,57	870,37	1.390,00	1.159,73
davon weitere Deckungswerte	59,50	59,50	65,59	63,23	51,54	48,76	84,76	83,28
Überdeckung in %	50,73%	37,21%	57,84%	43,35%	58,38%	45,87%	58,29%	41,74%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			8,18%	8,52%				

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

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019
bis zu 6 Monate	86,76	56,05	-	-	86,76	56,05
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	34,42	25,94	20,00	-	14,42	25,94
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	40,37	33,38	20,00	-	20,37	33,38
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	42,46	37,03	20,00	20,00	22,46	17,03
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	82,45	71,70	55,00	40,00	27,45	31,70
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	104,43	76,29	60,00	55,00	44,43	21,29
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	124,66	99,10	45,00	60,00	79,66	39,10
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	389,35	371,77	525,00	520,00	-135,65	-148,23
über 10 Jahre	218,03	182,34	-	-	218,03	182,34

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)

	31.12.2020				31.12.2019				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	-	-	-	-	-	-	-	-	
Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung <sup>a)</sup>									
		§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
		31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019
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

<sup>a)</sup> 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	
	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019
keine	-	-	-	-	-	-

	31.12.2020	31.12.2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,48%	97,18%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	55,29%	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)	4,77	4,50

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

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	31.12.2020		31.12.2019		Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)	31.12.2020		31.12.2019		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen							59,50	59,50	7,99%		
bis einschließlich 300 T€	751,41	640,29				weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	-	-	0,00%		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	127,39	100,00				davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	-	-	0,00%		
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	136,97	118,75				davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	0,00%		
mehr als 10 Mio.€	47,67	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	874,84	732,37				Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	-	-	0,00%		
gewerblich	188,61	161,75				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	1.122,94	953,61	150,73%		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland											
Eigentumswohnungen	282,93	212,97	25,20%								
Ein- und Zweifamilienhäuser	493,23	429,60	43,92%								
Mehrfamilienhäuser	98,67	89,79	8,79%								
Bürogebäude	28,46	18,70	2,53%								
Handelsgebäude	41,21	40,18	3,67%								
Industriegebäude	65,75	55,09	5,86%								
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	53,19	47,78	4,74%								
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	
	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2020	31.12.2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-