

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress*	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	911,30	207,20	934,86	220,97	913,61	206,93
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.369,76	1.426,73	1.523,40	1.622,10	1.349,03	1.423,07
davon Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	50,31%	588,58%	62,95%	634,09%	47,66%	587,70%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	II 2021			II 2020		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	121,21	45,00	76,21	139,40	-	139,40
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	62,70	50,00	12,70	53,82	20,90	32,92
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	74,85	-	74,85	45,23	45,00	0,23
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	59,18	60,00	- 0,82	61,51	50,00	11,51
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	141,21	-	141,21	137,90	60,00	77,90
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	146,62	100,00	46,62	129,51	-	129,51
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	159,48	105,00	54,48	132,87	-	132,87
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	438,28	376,30	61,98	536,16	31,30	504,86
über 10 Jahre	166,22	175,00	- 8,78	190,35	-	190,35

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2021	II 2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	92,97%	93,19%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	20,44%	100,00%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
	-	-	-	-	-	-	÷	÷	÷	÷

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt dynamisch.

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte

Nach Größenklassen	II 2021	II 2020
bis einschließlich 300 T€	521,58	571,87
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	290,70	285,95
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	491,92	524,35
mehr als 10 Mio.€	21,86	21,86

Nach Nutzungsart (I) in Deutschland	II 2021	II 2020
wohnwirtschaftlich	866,64	915,47
gewerblich	459,42	488,57

Nach Nutzungsart (II) in Deutschland	II 2021	Anteil an der Deckungsmasse	II 2020	Anteil an der Deckungsmasse
Eigentumswohnungen	83,70	6,11%	89,62	6,28%
Ein- und Zweifamilienhäuser	412,14	30,09%	437,02	30,63%
Mehrfamilienhäuser	370,81	27,07%	388,83	27,25%
Bürogebäude	93,62	6,83%	94,51	6,62%
Handelsgebäude	46,78	3,42%	50,88	3,57%
Industriegebäude	75,79	5,53%	80,60	5,65%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	238,26	17,39%	257,20	18,03%
unfertige / nicht ertragsfähige Neubauten	-	0,00%	-	0,00%
Bauplätze	4,97	0,36%	5,37	0,38%

Weitere Kennzahlen		II 2021	II 2020
§28 (1) Nr. 7 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) PfandBG überschreiten.	in Mio. €	-	-
§28 (1) Nr. 11 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning).	in Jahren	6,26	5,59
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	53,91%	54,30%

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. €	1.326,06	1.404,03
Anteil am Gesamtumlauf	in %	145,51%	677,62%

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG	II 2021	II 2020
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten	-	-
§ 19 (1) Nr. 2 PfandBG	-	-
§ 19 (1) Nr. 3 PfandBG	-	-

§ 28 (1) Nr. 4, 5 und 6 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragene Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1 PfandBG		§ 19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen*		§ 19 Abs. 1 Nr 3 PfandBG 20%-Grenze		Gesamt	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	9,20	18,70	9,20	18,70
Lettland	-	-	-	-	-	-	2,50	-	2,50	-
Litauen	-	-	-	-	-	-	5,00	-	5,00	-
Norwegen	-	-	-	-	-	-	5,00	-	5,00	-
Rumänien	-	-	-	-	-	-	9,00	4,00	9,00	4,00
Österreich	-	-	-	-	-	-	13,00	-	13,00	-
Gesamt	-	-	-	-	-	-	43,70	22,70	43,70	22,70

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	II 2021	II 2020	II 2021	II 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	0,00	-	-
Summe	-	0,00	-	-