

### 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*	
	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	866,30	207,20	882,85	219,78	868,11	208,37
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.365,30	1.380,76	1.496,86	1.571,03	1.326,64	1.382,10
davon Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	57,60%	566,39%	69,55%	614,81%	52,82%	563,30%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	IV 2021			IV 2020		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	123,19	50,00	73,19	123,39	20,90	102,49
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	66,93	-	66,93	44,50	-	0,50
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	54,96	60,00	- 5,04	62,30	50,00	12,30
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	71,38	-	71,38	80,43	-	80,43
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	132,55	-	132,55	123,78	60,00	63,78
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	169,30	100,00	69,30	128,41	-	128,41
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	139,67	105,00	34,67	165,94	-	165,94
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	439,02	376,30	62,72	471,82	31,30	440,52
über 10 Jahre	168,30	175,00	- 6,70	180,19	-	180,19

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	IV 2021	IV 2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,35%	93,61%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	16,31%	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	
	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 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	IV 2021	IV 2020
bis einschließlich 300 T€	496,69	545,45
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	283,43	294,06
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	522,62	506,18
mehr als 10 Mio.€	21,86	21,86

Nach Nutzungsart (I) in Deutschland	IV 2021	IV 2020
wohnwirtschaftlich	855,56	886,32
gewerblich	469,05	481,24

Nach Nutzungsart (II) in Deutschland	IV 2021	Anteil an der Deckungsmasse	IV 2020	Anteil an der Deckungsmasse
Eigentumswohnungen	87,91	6,44%	85,38	6,18%
Ein- und Zweifamilienhäuser	393,46	28,82%	420,73	30,47%
Mehrfamilienhäuser	374,19	27,41%	380,21	27,54%
Bürogebäude	89,51	6,56%	93,30	6,76%
Handelsgebäude	46,40	3,40%	48,05	3,48%
Industriegebäude	78,94	5,78%	81,29	5,89%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	250,17	18,32%	253,35	18,35%
unfertige / nicht ertragsfähige Neubauten	-	0,00%	-	0,00%
Bauplätze	4,04	0,30%	5,24	0,38%

Weitere Kennzahlen		IV 2021	IV 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	6,48	5,94
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	53,69%	54,10%

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. €	1.324,60	1.367,56
Anteil am Gesamtumlauf	in %	152,90%	660,02%

**III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte**

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG	IV 2021	IV 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	
	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	19,20	9,20	19,20	9,20
Lettland	-	-	-	-	-	-	2,50	-	2,50	-
Litauen	-	-	-	-	-	-	5,00	-	5,00	-
Norwegen	-	-	-	-	-	-	5,00	-	5,00	-
Rumänien	-	-	-	-	-	-	9,00	4,00	9,00	4,00
Gesamt	-	-	-	-	-	-	40,70	13,20	40,70	13,20

**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	
	IV 2021	IV 2020	IV 2021	IV 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-