

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*	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	836,30	207,20	848,02	217,19	838,38	207,11
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.369,70	1.355,44	1.434,12	1.517,69	1.274,47	1.339,94
davon Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	63,78%	554,17%	69,11%	598,78%	52,02%	546,98%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	I 2022			I 2021		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	122,88	20,00	102,88	121,42	30,90	90,52
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	73,17	45,00	28,17	63,75	65,00	1,25
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	38,70	15,00	23,70	47,03	20,00	27,03
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	68,74	-	68,74	82,81	45,00	37,81
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	148,47	-	148,47	105,98	15,00	90,98
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	176,52	100,00	76,52	152,14	-	152,14
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	124,59	105,00	19,59	162,93	-	162,93
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	448,25	376,30	71,95	444,20	31,30	412,90
über 10 Jahre	168,38	175,00	- 6,62	175,18	-	175,18

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	I 2022	I 2021
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,29%	93,62%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	13,31%	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	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
	-	-	-	-	-	-	÷	÷	÷	÷

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

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte

Nach Größenklassen	I 2022	I 2021
bis einschließlich 300 T€	487,83	532,86
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	283,71	295,94
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	525,51	486,57
mehr als 10 Mio.€	31,94	21,86

Nach Nutzungsart (I) in Deutschland	I 2022	I 2021
wohnwirtschaftlich	855,28	873,97
gewerblich	473,71	463,27

Nach Nutzungsart (II) in Deutschland	I 2022	Anteil an der Deckungsmasse	I 2021	Anteil an der Deckungsmasse
Eigentumswohnungen	86,87	6,34%	84,92	6,27%
Ein- und Zweifamilienhäuser	386,46	28,22%	416,38	30,72%
Mehrfamilienhäuser	381,95	27,89%	372,67	27,49%
Bürogebäude	96,11	7,02%	92,05	6,79%
Handelsgebäude	45,52	3,32%	47,21	3,48%
Industriegebäude	71,57	5,23%	77,00	5,68%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	256,56	18,73%	241,98	17,85%
unfertige / nicht ertragsfähige Neubauten	-	0,00%	-	0,00%
Bauplätze	3,95	0,29%	5,03	0,37%

Weitere Kennzahlen		I 2022	I 2021
§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	6,57	6,1
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	53,66%	53,94%

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. €	1.329,00	1.337,24
Anteil am Gesamtumlauf	in %	158,91%	645,38%

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG	I 2022	I 2021
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	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
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	9,00	9,00	9,00
Gesamt	-	-	-	-	-	-	40,70	18,20	40,70	18,20

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	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-