

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*	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	901,30	207,20	922,95	220,93	907,88	208,17
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.375,74	1.400,34	1.524,17	1.595,13	1.349,12	1.400,69
davon Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	52,64%	575,84%	65,14%	622,01%	48,60%	572,87%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	III 2021			III 2020		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	134,16	65,00	69,16	126,86	-	126,86
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	42,44	20,00	22,44	47,24	30,90	16,34
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	83,30	45,00	38,30	63,46	65,00	- 1,54
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	41,43	15,00	26,43	47,46	20,00	27,46
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	163,40	-	163,40	129,94	60,00	69,94
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	143,45	100,00	43,45	150,81	-	150,81
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	165,66	105,00	60,66	138,80	-	138,80
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	428,80	376,30	52,50	511,82	31,30	480,52
über 10 Jahre	173,09	175,00	- 1,91	183,97	-	183,97

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	III 2021	III 2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,32%	93,84%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	19,56%	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	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 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	III 2021	III 2020
bis einschließlich 300 T€	509,81	560,57
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	284,60	286,47
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	518,76	518,23
mehr als 10 Mio.€	21,86	21,86

Nach Nutzungsart (I) in Deutschland	III 2021	III 2020
wohnwirtschaftlich	865,19	903,36
gewerblich	469,85	483,78

Nach Nutzungsart (II) in Deutschland	III 2021	Anteil an der Deckungsmasse	III 2020	Anteil an der Deckungsmasse
Eigentumswohnungen	89,18	6,48%	87,54	6,25%
Ein- und Zweifamilienhäuser	404,90	29,43%	426,94	30,49%
Mehrfamilienhäuser	371,11	26,98%	388,88	27,77%
Bürogebäude	90,22	6,56%	94,32	6,74%
Handelsgebäude	46,32	3,37%	51,21	3,66%
Industriegebäude	77,47	5,63%	78,25	5,59%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	251,75	18,30%	254,68	18,19%
unfertige / nicht ertragsfähige Neubauten	-	0,00%	-	0,00%
Bauplätze	4,10	0,30%	5,31	0,38%

Weitere Kennzahlen		III 2021	III 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	6,35	5,79
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	53,80%	54,19%

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. €	1.335,04	1.387,14
Anteil am Gesamtumlauf	in %	148,12%	669,47%

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG	III 2021	III 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	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 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	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-