



Stichtag: 31.03.2021

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)	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	160,10	190,10	170,37	206,15	162,46	193,81	179,41	220,14
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	576,55	592,43	638,96	665,56	563,93	587,65	730,43	760,22
davon gattungsspezifische Deckungswerte	562,55	577,43	624,85	650,46	549,91	572,62	715,78	744,49
davon weitere Deckungswerte	14,00	15,00	14,11	15,10	14,02	15,03	14,65	15,74
Überdeckung in %	260,12%	211,64%	275,03%	222,85%	247,12%	203,20%	307,14%	245,33%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			8,28%	7,32%				

II) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2021		Laufzeitstruktur I 2020		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2021	I 2020
bis zu 6 Monate	32,14	30,10	38,94	20,00	2,04	18,94
mehr als 6 Monate bis zu zwölf Monaten	22,26	65,00	24,29	10,00	-42,74	14,29
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	32,94	0,00	23,01	30,10	32,94	-7,09
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	30,79	10,00	24,38	65,00	20,79	-40,62
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	57,06	30,00	60,99	10,00	27,06	50,99
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	76,86	0,00	57,52	30,00	76,86	27,52
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	61,99	15,00	79,75	0,00	46,99	79,75
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	188,69	5,00	210,88	20,00	183,69	190,88
über 10 Jahre	73,83	5,00	72,66	5,00	68,83	67,66

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)

Weitere Deckung nach	I 2021				I 2020				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	0,00			0,00	0,00			0,00	0,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung	§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	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	14,00	15,00	14,00	15,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	14,00	15,00	14,00	15,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

	I 2021	I 2020
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	95,59%	96,66%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	53,04%	53,27%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	0,00	0,00
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	6,34	6,12

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2021	I 2020	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckungswerte)	I 2021	I 2020	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte	14,00	15,00	8,74%	
bis einschließlich 300 T€	408,40	424,55	70,84%		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	85,29	75,13	14,79%		davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio.€	68,86	77,75	11,94%		davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	0,00	0,00%
mehr als 10 Mio.€	0,00	0,00	0,00%		Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	14,00	15,00	8,74%	
wohnwirtschaftlich	498,46	507,85	86,46%	Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%	
gewerblich	64,09	69,58	11,12%					
Summe gattungsklassische und weitere Deckung					576,55	592,43	360,12%	
nach Nutzungsart (II) in Deutschland								
Eigentumswohnungen	87,04	90,80	15,10%					
Ein- und Zweifamilienhäuser	292,93	297,40	50,81%					
Mehrfamilienhäuser	118,49	119,66	20,55%					
Bürogebäude	14,88	17,62	2,58%					
Handelsgebäude	17,86	17,85	3,10%					
Industriegebäude	12,55	13,49	2,18%					
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	18,80	20,62	3,26%					
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%					
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%					

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 2 Pfandbriefgesetz

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00

VI) Anhang zum Jahresabschluss

(Angaben in Mio. Euro)

	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsversteigerungsverfahren	-	-	-	-
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsverwaltungsverfahren	-	-	-	-
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsverwaltungsverfahren mit gleichzeitigem Zwangsversteigerungsverfahren	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten übernommenen Grundstücke	-	-	-	-
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen	0,00	-	-	-