

| | |
|----------|-----------|
| Stichtag | Mrz. 2021 |
| Referenz | Mrz. 2020 |

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

| § 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse | Nennwert | | Barwert | | Risikobarwert* | |
|---|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------|-----------|
| | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate | 7.855,1 | 6.815,6 | 8.291,2 | 7.332,5 | 8.848,9 | 7.975,8 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate | 8.705,4 | 7.454,8 | 9.643,6 | 8.327,8 | 10.135,9 | 8.774,4 |
| % Fremdwährungsderivate v. Passiva | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% |
| % Zinsderivate v. Passiva | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% |
| % Fremdwährungsderivate v. Aktiva | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% |
| % Zinsderivate v. Aktiva | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 0,0% |
| Überdeckung in % | 10,8% | 9,4% | 16,3% | 13,6% | 14,5% | 10,0% |

| § 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist | Pfandbriefumlauf | | Deckungsmasse | |
|--|------------------|-----------|---------------|-----------|
| | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 |
| bis zu sechs Monate | 45,0 | 50,0 | 476,9 | 324,9 |
| mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten | 500,0 | 535,0 | 438,0 | 397,3 |
| mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten | 545,0 | 45,0 | 468,0 | 357,5 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 505,0 | 500,0 | 497,9 | 373,3 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 1.222,5 | 1.050,0 | 1.005,6 | 795,2 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 1.158,0 | 222,5 | 1.054,8 | 786,5 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 250,0 | 658,0 | 806,8 | 797,7 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 2.628,0 | 2.638,0 | 3.015,4 | 2.722,5 |
| mehr als 10 Jahre | 1.001,6 | 1.117,1 | 941,9 | 900,0 |

| §28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen | Mrz. 21 | Mrz. 20 |
|--|---------|---------|
| Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | 92,5% | 90,6% |
| Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | 69,9% | 90,4% |

| § 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 | |
|--|--|-----------|---|-----------|-------------|-----------|---------------------------------|-----------|---------------------|-----------|
| | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 |
| | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

In der Deckung befinden sich keine Derivate.

* Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse gem. § 12 PfandBG

(Angaben in Mio. Euro)

| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 |
|---|-----------|-----------|
| nach Größenklassen | | |
| bis zu 300 Tsd. € | 6.043,1 | 5.387,4 |
| mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. € | 1.053,5 | 814,0 |
| mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. € | 698,2 | 714,5 |
| mehr als 10 Mio. € | 400,7 | 323,8 |
| nach Nutzungsart (I) | | |
| wohnwirtschaftlich | 6.653,0 | 5.743,1 |
| gewerblich | 1.542,5 | 1.496,7 |

| Kennzahlen | Mrz. 2021 | | Mrz. 2020 | |
|--|-------------|-------|-------------|-------|
| § 28 (1) Nr. 7 PfandBG | in Mio. EUR | in % | in Mio. EUR | in % |
| Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1) | - | 0,0 | - | 0,0 |
| § 28 (1) Nr. 11 PfandBG | Jahre | | Jahre | |
| vdw.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen | 5,4 | | 4,7 | |
| § 28 (2) Nr. 3 PfandBG | in % | | in % | |
| durchschn. gew. Beleihungsauslauf | 55,0% | | 55,4% | |
| Anteil am Gesamtumlauf | in Mio. EUR | in % | in Mio. EUR | in % |
| Ordentliche Deckung (nominal) | 8.195,4 | 104,3 | 7.239,8 | 106,2 |

| nach Nutzungsart (II) | Land | Stichtag | Eigentums- wohnungen | Ein- und Zweifamilien- häuser | Mehrfamilien- häuser | Bürogebäude | Handelsgebäude | Industrie-gebäude | sonstige gewerblich genutzte Gebäude | unfertige und noch nicht ertrags-fähige Neubauten sowie Bauplätze | davon Bauplätze | Summe |
|----------------------------|------|----------|-------------------------|----------------------------------|-------------------------|-------------|----------------|-------------------|---|---|-----------------|---------|
| Bundesrepublik Deutschland | | Mrz. 21 | 2.006,1 | 3.904,1 | 742,8 | 292,0 | 23,4 | - | 1.227,1 | - | - | 8.195,4 |
| | | Mrz. 20 | 1.757,7 | 3.377,3 | 608,1 | 10,7 | 23,5 | - | 1.462,6 | - | - | 7.239,8 |
| Summe | | Mrz. 21 | 2.006,1 | 3.904,1 | 742,8 | 292,0 | 23,4 | - | 1.227,1 | - | - | 8.195,4 |
| | | Mrz. 20 | 1.757,7 | 3.377,3 | 608,1 | 10,7 | 23,5 | - | 1.462,6 | - | - | 7.239,8 |

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

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

| § 28 (1) Nr. 4, 5 und 6 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen | Ausgleichsforderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 1 PfandBG | | Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 2 PfandBG | | | | Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 3 PfandBG | | Summe | |
|---|---|-----------|--|-----------|--|-----------|---|-----------|-----------|-----------|
| | | | Gesamt | | davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013 | | | | | |
| | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 |
| Bundesrepublik Deutschland | - | - | - | - | - | - | 460,0 | 165,0 | 460,0 | 165,0 |
| Niederlande | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Europäische Institutionen | - | - | - | - | - | - | 50,0 | 50,0 | 50,0 | 50,0 |
| Summe | - | - | - | - | - | - | 510,0 | 215,0 | 510,0 | 215,0 |

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

| § 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat | Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen | | Gesamtbetrag der leistungsgestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt | |
|---------------------------------|--|-----------|---|-----------|
| | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 | Mrz. 2021 | Mrz. 2020 |
| keine | - | - | - | - |
| Summe | - | - | - | - |

Abweichungen können aus Rundungsdifferenzen resultieren.