

|          |          |
|----------|----------|
| Stichtag | III 2021 |
| Referenz | III 2020 |

**I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag**

(Angaben in Mio. Euro)

|  | Nennwert |          | Barwert  |          | Risikobarwert *)<br>(Verschieb. nach oben) |          | Risikobarwert *)<br>(Verschieb. nach unten) |          |
|--|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
|  | III 2021 | III 2020 | III 2021 | III 2020 | III 2021                                   | III 2020 | III 2021                                    | III 2020 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs                 | 215,00   | 235,00   | 234,70   | 263,59   | 211,78                                     | 239,45   | 262,11                                      | 292,22   |
| Gesamtbetrag der Deckungsmassen                    | 881,86   | 832,28   | 976,50   | 951,12   | 845,67                                     | 822,89   | 1.137,77                                    | 1.109,21 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte             | 836,86   | 802,28   | 930,26   | 919,65   | 803,46                                     | 794,65   | 1.087,08                                    | 1.074,11 |
| davon weitere Deckungswerte                        | 45,00    | 30,00    | 46,24    | 31,46    | 42,21                                      | 28,24    | 50,69                                       | 35,10    |
| Überdeckung in %                                   | 310,17%  | 254,16%  | 316,07%  | 260,83%  | 299,32%                                    | 243,65%  | 334,09%                                     | 279,58%  |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % |          |          | 4,41%    |          |  |          |   |          |

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

(Angaben in Mio. Euro)

|  | Laufzeitstruktur III 2021 |                       | Laufzeitstruktur III 2020 |                       | Überhang |          |
|--|---------------------------|-----------------------|---------------------------|-----------------------|----------|----------|
|  | Deckungs-<br>masse        | Pfandbrief-<br>umlauf | Deckungs-<br>masse        | Pfandbrief-<br>umlauf | III 2021 | III 2020 |
| bis zu sechs Monate                        | 40,89                     | 50,00                 | 36,39                     | 30,00                 | -9,11    | 6,39     |
| mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten | 30,71                     | 10,00                 | 31,77                     | 10,00                 | 20,71    | 21,77    |
| mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten    | 33,88                     | 20,00                 | 27,98                     | 50,00                 | 13,88    | -22,02   |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren         | 30,98                     | 0,00                  | 32,67                     | 10,00                 | 30,98    | 22,67    |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren           | 74,05                     | 15,00                 | 68,34                     | 20,00                 | 59,05    | 48,34    |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren           | 93,96                     | 10,00                 | 74,93                     | 15,00                 | 83,96    | 59,93    |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren           | 89,81                     | 10,00                 | 92,87                     | 10,00                 | 79,81    | 82,87    |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren          | 311,82                    | 100,00                | 304,53                    | 70,00                 | 211,82   | 234,53   |
| über 10 Jahre                              | 175,78                    | 0,00                  | 162,79                    | 20,00                 | 175,78   | 142,79   |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) statistischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

**III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)**

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

| Weitere Deckung nach     | III 2021           |                         |                   |                  | III 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 | -                  | -                       | -                 | -                | -                  | -                       | -                 | -                | -               |
| §19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2 | -                  | -                       | -                 | -                | -                  | -                       | -                 | -                | 10,00%          |
| §19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3 | -                  | -                       | -                 | -                | -                  | -                       | -                 | -                | 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        |              |
|--|-------------------------------------|----------|---|----------|-----------------------------------|--------------|--------------|--------------|
|  | III 2021                            | III 2020 | III 2021  | III 2020 | III 2021                          | III 2020     | III 2021     | III 2020     |
| Bundesrepublik Deutschland                       | -                                   | -        | -   | -        | 45,00                             | 30,00        | 45,00        | 30,00        |
| <b>Summe</b>                                     | -                                   | -        | -   | -        | <b>45,00</b>                      | <b>30,00</b> | <b>45,00</b> | <b>30,00</b> |

| Nettobarwert je Fremdwährung | Barwert der Deckungsmassen |          | Barwert des Pfandbriefumlaufs |          | Nettobarwert in Fremdwährung |          |
|------------------------------|----------------------------|----------|-------------------------------|----------|------------------------------|----------|
|                              | III 2021                   | III 2020 | III 2021                      | III 2020 | III 2021                     | III 2020 |
| keine                        | -                          | -        | -                             | -        | -                            | -        |

|  | III 2021 | III 2020 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte  | 97,95%   | 99,00%   |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe  | 100,00%  | 100,00%  |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf   | 54,44%   | 54,39%   |
| Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist( §13 Abs. 1 PfandBG ) | -        | -        |
| volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit  | 5,00     | 4,91     |

|          |          |
|----------|----------|
| Stichtag | III 2021 |
| Referenz | III 2020 |

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

(Angaben in Mio. Euro)

| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | III 2021 | III 2020 | Anteil<br>am Gesamtbetrag der<br>Deckungsmasse | Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (weitere Deckung)   | III 2021 | III 2020 | Anteil<br>am Gesamtbetrag des<br>Pfandbriefumlaufs |
|--|----------|----------|--|--|----------|----------|--|
| <b>nach Größenklassen</b>                            |          |          |  | <b>weitere Deckungswerte</b>   |          |          |  |
| bis einschließlich 300 T€                            | 775,60   | 745,82   |  | weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto                       | 45,00    | 30,00    | 20,93%   |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€           | 49,26    | 44,32    |  | davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG   | -        | -        | 0,00%  |
| mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€         | 12,01    | 12,13    |  | davon höchste Geldforderung geg. KI                                      | -        | -        | 0,00%  |
| mehr als 10 Mio.€                                    | -        | -        |  | Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG                               | -        | -        | 0,00%  |
| <b>nach Nutzungsart (I) in Deutschland</b>           |          |          |  | Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)    |          |          |  |
| wohnwirtschaftlich                                   | 811,58   | 774,56   |  | Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. la PfandBG | 10,00    | 10,00    | 4,65%  |
| gewerblich   | 25,28    | 27,72    |  |  | 35,00    | 20,00    | 16,28%   |
| <b>nach Nutzungsart (II) in Deutschland</b>          |          |          |  | <b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>                      |          |          |  |
| Eigentumswohnungen                                   | 116,30   | 109,84   | 13,19%   |  | 881,86   | 832,28   | 410,17%  |
| Ein- und Zweifamilienhäuser                          | 593,64   | 563,18   | 67,32%   |  |          |          |  |
| Mehrfamilienhäuser                                   | 101,64   | 101,54   | 11,53%   |  |          |          |  |
| Bürogebäude  | 3,09     | 3,56     | 0,35%  |  |          |          |  |
| Handelsgebäude                                       | 0,27     | 0,48     | 0,03%  |  |          |          |  |
| Industriegebäude                                     | 12,40    | 13,45    | 1,41%  |  |          |          |  |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude                 | 9,53     | 10,23    | 1,08%  |  |          |          |  |
| unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten          | -        | -        | 0,00%  |  |          |          |  |
| Bauplätze  | -        | -        | 0,00%  |  |          |          |  |

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

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

(Angaben in Mio. Euro)

| Länder                     | Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen |             | Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag |             |
|----------------------------|--|-------------|--|-------------|
|                            | III 2021                                   | III 2020    | III 2021                                       | III 2020    |
| Bundesrepublik Deutschland | 0,00                                       | 0,00        | 0,00   | 0,00        |
| <b>Summe</b>               | <b>0,00</b>                                | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                                    | <b>0,00</b> |