

Stichtag	31.03.2022
Referenz	31.03.2021

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 *	
	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	165,00	205,00	171,54	226,75	152,26	205,62
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	902,50	849,47	934,30	952,54	811,21	824,61
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	446,97%	314,38%	444,65%	320,09%	432,77%	301,03%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021
bis zu sechs Monate	10,00	10,00	41,15	40,62
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	20,00	50,00	32,20	27,32
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	10,00	30,08	32,23
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	15,00	20,00	33,67	35,19
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	15,00	86,34	66,78
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	20,00	0,00	86,61	87,60
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	20,00	88,03	74,22
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	100,00	80,00	327,94	309,78
über 10 Jahre	0,00	0,00	176,47	175,73

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	31.03.2022	31.03.2021
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	98,18%	98,71%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	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	
	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

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

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	31.03.2022	31.03.2021
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	799,09	760,40
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	49,95	46,98
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	8,46	12,09
mehr als 10 Mio. €	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	31.03.2022	31.03.2021
wohnwirtschaftlich	835,49	793,38
gewerblich	22,01	26,09

Weitere Kennzahlen		31.03.2022	31.03.2021
§28 (1) Nr. 7 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) PfandBG überschreiten.	in Mio. EUR	0,00	0,00%
§28 (1) Nr. 11 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning).	in Jahren	5,05	4,94
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	54,44%	54,43%
Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	857,50	819,47
Anteil am Gesamtumlauf	in %	519,70%	399,74%

nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Staat											
Bundesrepublik Deutschland	31.03.2022	123,66	612,79	99,05	2,65	0,24	11,55	7,57	0,00	0,00	<b>857,50</b>
	31.03.2021	112,27	580,03	101,08	3,45	0,36	11,89	10,39	0,00	0,00	<b>819,47</b>
<b>Summe</b>	<b>31.03.2022</b>	<b>123,66</b>	<b>612,79</b>	<b>99,05</b>	<b>2,65</b>	<b>0,24</b>	<b>11,55</b>	<b>7,57</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>857,50</b>
	<b>31.03.2021</b>	<b>112,27</b>	<b>580,03</b>	<b>101,08</b>	<b>3,45</b>	<b>0,36</b>	<b>11,89</b>	<b>10,39</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>819,47</b>

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten	31.03.22	31.03.21
§19 (1) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00
§19 (1) Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00

§ 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 Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		31.03.22	31.03.21	31.03.22	31.03.21	
Staat										
Bundesrepublik Deutschland	31.03.22	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	45,00	30,00	<b>45,00</b>	<b>30,00</b>
<b>Summe</b>	<b>31.03.22</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>45,00</b>	<b>30,00</b>	<b>45,00</b>	<b>30,00</b>

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	31.03.2022	31.03.2021	31.03.2022	31.03.2021
keine	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>