

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*	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	816,30	911,30	824,09	934,86	810,78	913,61
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.375,56	1.369,76	1.376,19	1.523,40	1.224,21	1.349,03
davon Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
davon Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
davon Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	68,51%	50,31%	66,99%	62,95%	50,99%	47,66%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	II 2022			II 2021		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	132,40	-	132,40	121,21	45,00	76,21
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	53,06	60,00	- 6,94	62,70	50,00	12,70
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	50,91	-	50,91	74,85	-	74,85
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	80,94	-	80,94	59,18	60,00	- 0,82
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	136,69	100,00	36,69	141,21	-	141,21
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	149,84	105,00	44,84	146,62	100,00	46,62
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	137,30	100,00	37,30	159,48	105,00	54,48
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	449,94	276,30	173,64	438,28	376,30	61,98
über 10 Jahre	184,48	175,00	9,48	166,22	175,00	- 8,78

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2022	II 2021
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,19%	92,97%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	11,18%	20,44%

§ 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	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
	-	-	-	-	-	-	÷	÷	÷	÷

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

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte

Nach Größenklassen	II 2022	II 2021
bis einschließlich 300 T€	477,86	521,58
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	282,85	290,70
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	542,21	491,92
mehr als 10 Mio.€	31,94	21,86

Nach Nutzungsart (I) in Deutschland	II 2022	II 2021
wohnwirtschaftlich	849,70	866,64
gewerblich	485,16	459,42

Nach Nutzungsart (II) in Deutschland	II 2022	Anteil an der Deckungsmasse	II 2021	Anteil an der Deckungsmasse
Eigentumswohnungen	77,61	5,64%	83,70	6,11%
Ein- und Zweifamilienhäuser	373,30	27,14%	412,14	30,09%
Mehrfamilienhäuser	398,79	28,99%	370,81	27,07%
Bürogebäude	97,10	7,06%	93,62	6,83%
Handelsgebäude	45,04	3,27%	46,78	3,42%
Industriegebäude	69,95	5,09%	75,79	5,53%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	269,18	19,57%	238,26	17,39%
unfertige / nicht ertragsfähige Neubauten	-	0,00%	-	0,00%
Bauplätze	3,89	0,28%	4,97	0,36%

Weitere Kennzahlen		II 2022	II 2021
§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	6,55	6,26
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	53,70%	53,91%

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. €	1.334,86	1.326,06
Anteil am Gesamtumlauf	in %	163,53%	145,51%

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG	II 2022	II 2021
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	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	19,20	9,20	19,20	9,20
Lettland	-	-	-	-	-	-	2,50	2,50	2,50	2,50
Litauen	-	-	-	-	-	-	5,00	5,00	5,00	5,00
Norwegen	-	-	-	-	-	-	5,00	5,00	5,00	5,00
Rumänien	-	-	-	-	-	-	9,00	9,00	9,00	9,00
Österreich	-	-	-	-	-	-	-	13,00	-	13,00
Gesamt	-	-	-	-	-	-	40,70	43,70	40,70	43,70

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	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-