

## Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 30.06.2022

### I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 1 und 3

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert <sup>1)</sup>	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
Hypothekendarlehen	6.594,9	6.524,1	6.567,6	7.083,4	6.161,6	6.768,9
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	7.908,5	8.123,5	7.834,7	8.879,3	7.250,8	8.497,2
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	1.313,6	1.599,4	1.267,1	1.795,9	1.089,2	1.728,3
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-

<sup>1)</sup> Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. PfandBarwertV verwendet.

Der Ausweis der Nettobarwerte je Fremdwährung entfällt, da der Deckungsmasse ausschließlich Geschäfte auf Euro-Basis zugrundeliegen.

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	Laufzeitenstruktur des Hypothekendarlehens		Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
<= 0,5 Jahre	257,0	49,7	452,1	995,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	611,0	610,0	353,0	559,6
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	112,1	262,1	296,6	266,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	596,5	611,0	470,5	428,2
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.149,0	708,6	697,2	697,1
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.013,0	1.149,0	1.323,3	806,8
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	777,0	1.013,0	720,3	796,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.794,4	1.849,8	2.843,3	2.974,6
> 10 Jahre	285,0	271,0	752,1	599,2

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	30.06.2022	30.06.2021
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	84,0	82,0
Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	99,7	99,7

## II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

### PfandBG § 28 (2) Nr. 1

Angaben in Mio. EUR

a) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	30.06.2022	30.06.2021
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	2.353,3	2.382,8
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.611,5	1.566,4
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.385,4	2.534,7
Mehr als 10 Mio. EUR	1.008,3	1.039,6

### b) und c) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Nutzungsart und nach Staaten<sup>2)</sup>

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
Eigentumswohnungen	769,4	703,9	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	1.863,0	1.822,2	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.528,1	2.650,0	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	965,3	1.040,6
Handelsgebäude	-,-	-,-	229,5	249,0
Industriegebäude	-,-	-,-	190,9	184,4
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	812,4	873,4
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

<sup>2)</sup> keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

### PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	30.06.2022	30.06.2021
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) überschreiten (in Mio. EUR)	0,0	0,0
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (in Jahren)	7,4	7,2

### PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	30.06.2022	30.06.2021
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)	51,9	52,0

### III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2022	30.06.2021
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 2 übersteigen	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 3 übersteigen	0,0	0,0

#### PfandBG § 28 (1) Nr. 4, 5 und 6

	30.06.2022	30.06.2021
Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2	550,0	500,0
<i>davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d.Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013</i>	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 3	0,0	100,0

### IV) Übersicht der rückständigen Leistungen

#### PfandBG § 28 (2) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2022	30.06.2021
Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen	0,0	0,0
Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	0,0	0,0