

Stichtag	30.06.2022
Referenz	30.06.2021

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 *	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	800,00	765,00	756,21	806,54	665,94	703,45
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1.383,60	1.215,36	1.346,73	1.339,97	1.173,89	1.163,05
% 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 %	72,95%	58,87%	78,09%	66,14%	76,28%	65,33%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
bis zu sechs Monate	20,00	20,00	96,96	84,87
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	25,00	20,00	40,29	39,98
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	30,00	20,00	29,69	41,11
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,00	25,00	52,32	43,88
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	50,00	50,00	141,19	84,72
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	75,00	50,00	146,33	142,59
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	85,00	75,00	108,77	128,54
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	495,00	505,00	479,22	399,66
über 10 Jahre	0,00	-	288,84	250,01

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.06.2022	30.06.2021
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	96,66%	96,86%
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	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
	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	30.06.2022		30.06.2021		Weitere Kennzahlen	30.06.2022		30.06.2021	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021					
nach Größenklassen					§28 (1) Nr. 7 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) PfandBG überschreiten.	in Mio. EUR	0,00	0,00	
bis zu 300 Tsd. €	903,22	801,73			§28 (1) Nr. 11 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning).	in Jahren	4,92	4,84	
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	181,95	143,89			§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	55,76%	55,57%	
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	148,88	132,58			Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	1.324,10	1.155,86	
mehr als 10 Mio. €	90,05	77,66			Anteil am Gesamtumlauf	in %	165,51%	151,09%	
nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)									
wohnwirtschaftlich	1.092,79	951,39							
gewerblich	231,30	204,47							

nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags-fähige Neubauten	Bauplätze	Summe
											Summe
Bundesrepublik Deutschland	30.06.2022	383,92	579,14	129,74	62,43	40,89	70,93	57,05	0,00	0,00	1.324,10
	30.06.2021	318,66	519,42	113,30	43,11	40,92	68,50	51,93	0,00	0,00	1.155,84
Summe	30.06.2022	383,92	579,14	129,74	62,43	40,89	70,93	57,05	0,00	0,00	1.324,10
	30.06.2021	318,66	519,42	113,30	43,11	40,92	68,50	51,93	0,00	0,00	1.155,84

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	30.06.22	30.06.21
§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	
	Staat		Gesamt		davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
	30.06.22	30.06.21	30.06.22	30.06.21	30.06.22	30.06.21	30.06.22	30.06.21	30.06.22	30.06.21
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	53,50	53,50	53,50	53,50
Österreich	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6,00	6,00	6,00	6,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	59,50	59,50	59,50	59,50

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	
	30.06.2022	30.06.2021	30.06.2022	30.06.2021
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00