

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG
Hypothekendarlehen

1. Quartal 2026
Stichtag: 31.03.2026

„Deka





Inhaltsverzeichnis

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG

| | Seite(n) |
|--|----------|
| I. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten | 3 |
| II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell | 3 |
| III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse | 3 |
| IV. Gesamtbeträge nach Barwerten | 4 |
| V. Laufzeitstruktur | 5 |
| VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen | 6 |
| VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe | 7 |
| VIII. Volumengewichteter Durchschnitt der Laufzeit | 7 |
| IX. Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | 7 |
| X. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte | 8 |
| XI. Überschreitungen | 9 |
| XII. Aufteilung der Deckungsmasse nach Art der Nutzung | 10-12 |
| XIII. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR) | 13 |
| XIV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR) | 13 |
| XV. Kennzahlen zur Liquidität | 14 |
| XVI. Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung nach § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG | 15 |

Zusätzliche freiwillige Angaben

| | |
|--|-------|
| I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse | 16-19 |
| II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf | 20 |



I. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten

| Gesamtbeträge in Mio. EUR | Nennwert | | Barwert | |
|--|----------|----------|---------|----------|
| | Q1/2026 | Q1/2025* | Q1/2026 | Q1/2025* |
| Umlauf Hypothekendarlehen | 411,0 | 801,0 | 414,7 | 808,1 |
| Deckungsmasse für Hypothekendarlehen | 1.281,1 | 1.301,7 | 1.293,1 | 1.308,3 |
| Überdeckung | 870,1 | 500,7 | 878,4 | 500,2 |
| Überdeckung in Prozent vom Darlehensumlauf | 211,7 % | 62,5 % | 211,8 % | 61,9 % |
| Gesetzliche Überdeckung * | 16,5 | 31,9 | 8,3 | 16,2 |
| Vertragliche Überdeckung | - | - | - | - |
| Freiwillige Überdeckung | 853,6 | 468,9 | 870,1 | 484,1 |

* Das gesetzliche Überdeckungserfordernis setzt sich aus der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG inkl. Zins- und Währungsstressszenarien und der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG zusammen.

II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

| Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells in Mio. EUR | Nennwert | | Barwert | |
|--|----------|---------|---------|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Überdeckung nach dem vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell | 870,1 | 500,7 | 878,4 | 500,2 |
| Überdeckung in Prozent vom Darlehensumlauf | 211,7 % | 62,5 % | 211,8 % | 61,9 % |

III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse

| Gesamtbeträge in Mio. EUR | Nennwert | |
|---------------------------|----------|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Derivate | 0,0 | 0,0 |



IV. Gesamtbeträge nach Barwerten

| Gesamtbeträge in Mio. EUR | Risikobarwert + 250 BP | | Risikobarwert - 250 BP | | Risikobarwert Währungsstress | |
|--|------------------------|----------|------------------------|----------|------------------------------|----------|
| | Q1/2026 | Q1/2025* | Q1/2026 | Q1/2025* | Q1/2026 | Q1/2025* |
| Umlauf Hypothekendarlehen | 407,2 | 789,8 | 422,6 | 827,4 | 407,2 | 789,8 |
| Deckungsmasse für Hypothekendarlehen | 1.236,8 | 1.245,7 | 1.355,2 | 1.377,4 | 1.228,1 | 1.245,7 |
| Überdeckung | 829,6 | 455,9 | 932,6 | 550,0 | 821,0 | 455,9 |
| Überdeckung in Prozent vom Darlehensumlauf | 203,8 % | 57,7 % | 220,7 % | 66,5 % | 201,6 % | 57,7 % |

| Fremdwährungen | Nettobarwert in Fremdwährung (in Mio.) | | Wechselkurs | | Nettobarwert in Mio. EUR | |
|--------------------|--|---------|-------------|---------|--------------------------|-------------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| GBP | 51,2 | 0,0 | 0,86833 | 0,83536 | 58,9 | 0,0 |
| Gesamtsumme | | | | | 58,9 | 0,00 |

(*) Hinweis: Die Ermittlung des Risikobarwertes erfolgt nach Maßgabe des statischen Ansatzes gemäß PfandBarwertV



V. Laufzeitstruktur

| Laufzeitbänder | Pfandbriefumlauf in Mio. EUR | | Deckungsmasse in Mio. EUR | | Pfandbriefumlauf bei Fälligkeitsverschiebung um 12 Monate* in Mio. EUR | | Pfandbriefumlauf bei Fälligkeitsverschiebung um 12 Monate* in Mio. EUR | |
|------------------------|---------------------------------|--------------|------------------------------|----------------|---|--------------|---|--------------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025* | Q1/2026 | Q1/2025* |
| <= 6 Monate | 50,0 | 430,0 | 166,0 | 142,4 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 6 Monate <= 12 Monate | 256,0 | 10,0 | 63,4 | 105,1 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 12 Monate <= 18 Monate | 0,0 | 50,0 | 239,7 | 165,0 | 50,0 | 430,0 | 50,0 | 430,0 |
| 18 Monate <= 2 Jahre | 105,0 | 256,0 | 206,8 | 64,7 | 256,0 | 10,0 | 256,0 | 10,0 |
| 2 Jahre <= 3 Jahre | 0,0 | 55,0 | 256,3 | 423,6 | 105,0 | 306,0 | 105,0 | 306,0 |
| 3 Jahre <= 4 Jahre | 0,0 | 0,0 | 161,5 | 215,8 | 0,0 | 55,0 | 0,0 | 55,0 |
| 4 Jahre <= 5 Jahre | 0,0 | 0,0 | 88,9 | 121,8 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| 5 Jahre <= 10 Jahre | 0,0 | 0,0 | 98,6 | 63,4 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| > 10 Jahre | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Gesamtsumme | 411,0 | 801,0 | 1.281,1 | 1.301,7 | 411,0 | 801,0 | 411,0 | 801,0 |

* Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe:

Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe:

Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsunfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsunfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.

Der Sachwalter kann die Fälligkeiten der Tilgungszahlungen verschieben, wenn die maßgeblichen Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG hierfür erfüllt sind. Die Verschiebungsdauer, welche einen Zeitraum von 12 Monaten nicht überschreiten darf, bestimmt der Sachwalter entsprechend der Erforderlichkeit.

Der Sachwalter kann die Fälligkeiten von Tilgungs- und Zinszahlungen, die innerhalb eines Monats nach seiner Ernennung fällig werden, auf das Ende dieses Monatszeitraums verschieben. Entscheidet sich der Sachwalter für eine solche Verschiebung, wird das Vorliegen der Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG unwiderlegbar vermutet. Eine solche Verschiebung ist im Rahmen der Höchstverschiebungsdauer von 12 Monaten zu berücksichtigen.

Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

Der Sachwalter darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe einer Emission nur einheitlich Gebrauch machen. Hierbei dürfen die Fälligkeiten vollständig oder anteilig verschoben werden. Der Sachwalter hat die Fälligkeit für eine Pfandbriefemission so zu verschieben, dass die ursprüngliche Reihenfolge der Bedienung der Pfandbriefe, welche durch die Verschiebung überholt werden könnten, nicht geändert wird (Überholverbot). Dies kann dazu führen, dass auch die Fälligkeiten später fällig werdender Emissionen zu verschieben sind, um das Überholverbot zu wahren. Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2a und 2b PfandBG.



VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen

| Gesamtnennwert der Deckungsmasse nach Größenklassen (in Mio. EUR) | | Q1/2026 | Q1/2025 |
|--|-------------------------------|----------------|----------------|
| Ordentliche Deckung | <= 0,3 Mio. EUR | 0,0 | 0,0 |
| Grundpfandrechtl. besichert | | | |
| Ordentliche Deckung | 0,3 Mio. EUR <= 1,0 Mio. EUR | 0,0 | 0,0 |
| Grundpfandrechtl. besichert | | | |
| Ordentliche Deckung | 1,0 Mio. EUR <= 10,0 Mio. EUR | 44,1 | 35,4 |
| Grundpfandrechtl. besichert | | | |
| Ordentliche Deckung | > 10,0 Mio. EUR | 929,1 | 938,5 |
| Grundpfandrechtl. besichert | | | |
| Summe | | 973,2 | 973,9 |
| Weitere Deckungswerte gem. § 19 Absatz 1 und Werte der barwertigen sichernden Überdeckung gem. §4 Abs.1 S. 3 PfandBG | | 307,9 | 327,9 |
| Gesamtsumme | | 1.281,1 | 1.301,7 |



VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe

| Verhältnis der Gesamtsummen zu den Anteilen festverzinslicher Positionen | Gesamtbeträge in Mio. EUR | | davon: Nennwert an festverzinslichen Positionen | | davon: Prozentualer Anteil an festverzinslichen Positionen | |
|--|---------------------------|---------|---|---------|--|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| | Umlauf Hypothekendarlehen | 411,0 | 801,0 | 411,0 | 801,0 | 100,0 % |
| Deckungsmasse für Hypothekendarlehen | 1.281,1 | 1.301,7 | 1.151,4 | 1.120,0 | 89,9 % | 86,0 % |

VIII. Volumengewichteter Durchschnitt der Laufzeit

| Angaben zu Forderungen gem. § 12 PfandBG | Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen in Jahren | |
|--|--|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe gem. § 28 Abs.2 Nr. 4 PfandBG | 3,8 | 4,5 |

IX. Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf

| Angaben zu Forderungen gem. § 12 PfandBG | Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in Prozent | |
|---|---|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Beleihungsauslauf gem. § 28 Absatz 2 Satz 1 Nr. 3 PfandBG | 59,5 | 59,9 |



X. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte

| Gesamtbetrag der weiteren Deckungswerte gem. § 19 Abs. 1 S. 1 PfandBG | Gesamtbeträge in Mio. EUR | |
|--|---------------------------|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 |
| | 307,9 | 327,9 |

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S.1 Nr. 8 in Verbindung mit § 19 Abs. 1 Nr. 2 a) und b) PfandBG

| Sitzland der Schuldner | Code (*) | Gesamtbeträge in Mio. EUR | | davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013 | |
|----------------------------|-------------|---------------------------|--------------|--|--------------|
| | | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Bundesrepublik Deutschland | DE | 82,6 | 82,6 | 82,6 | 82,6 |
| Belgien | BE | 50,0 | 50,0 | 50,0 | 50,0 |
| Frankreich | FR | 69,1 | 41,1 | 69,1 | 41,1 |
| Spanien | ES | 0,0 | 20,0 | 0,0 | 20,0 |
| Gesamtsumme | | 201,7 | 193,7 | 201,7 | 193,7 |

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S.1 Nr. 9 in Verbindung mit § 19 Abs. 1 Nr. 3 a) bis c) PfandBG

| Sitzland der Schuldner | Code (*) | Gesamtbeträge in Mio. EUR | | davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013 | |
|----------------------------|-------------|---------------------------|-------------|--|-------------|
| | | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Bundesrepublik Deutschland | DE | 1,0 | 1,0 | 0,0 | 0,0 |
| Finnland | FI | 18,0 | 18,0 | 18,0 | 18,0 |
| Frankreich | FR | 0,0 | 28,0 | 0,0 | 28,0 |
| Norwegen | NO | 25,0 | 25,0 | 25,0 | 25,0 |
| Gesamtsumme | | 44,0 | 72,0 | 43,0 | 71,0 |

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 10 in Verbindung mit § 19 Abs. 1 Nr. 4 PfandBG (Schuldverschreibungen nach § 20 Abs. 1 PfandBG)

| Sitzland der Schuldner | Code (*) | Gesamtbeträge in Mio. EUR | |
|----------------------------|-------------|---------------------------|-------------|
| | | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Bundesrepublik Deutschland | DE | 50,0 | 50,0 |
| Belgien | BE | 12,2 | 12,2 |
| Gesamtsumme | | 62,2 | 62,2 |

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XI. Überschreitungen

| Angaben zu § 28 Absatz 1 S. 1 Nr. 11 und 12 PfandBG | Gesamtbeträge in Mio. EUR | |
|---|---------------------------|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Forderungen, die die Begrenzungen des § 13 Abs.1 S. 2 PfandBG überschreiten (§ 28 Abs.1 S. 1 Nr. 11 PfandBG) | 0,0 | 0,0 |
| Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs.1 S. 7 PfandBG überschreiten (§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11 PfandBG) | 0,0 | 0,0 |
| Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG überschreiten (§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12 PfandBG) | 0,0 | 0,0 |
| Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG überschreiten (§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12 PfandBG) | 0,0 | 0,0 |
| Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 4 PfandBG überschreiten (§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12 PfandBG) | 0,0 | 0,0 |



XII. Aufteilung der Deckungsmasse nach Art der Nutzung

| Gesamtsumme | Gewerblich | | Wohnwirtschaftlich | |
|--|--------------------|--------------|--------------------|------------|
| | Betrag in Mio. EUR | | Betrag in Mio. EUR | |
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Eigentumswohnungen | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Mehrfamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bürogebäude | 738,5 | 709,7 | 0,0 | 0,0 |
| Handelsgebäude | 0,0 | 63,0 | 0,0 | 0,0 |
| Industriegebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 234,7 | 201,1 | 0,0 | 0,0 |
| Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bauplätze | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 973,2 | 937,9 | 0,0 | 0,0 |



XII. Aufteilung der Deckungsmasse nach Art der Nutzung

| Bundesrepublik Deutschland | Gewerblich | | Wohnwirtschaftlich | |
|--|--------------------|--------------|--------------------|------------|
| | Betrag in Mio. EUR | | Betrag in Mio. EUR | |
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Eigentumswohnungen | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Mehrfamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bürogebäude | 234,1 | 232,6 | 0,0 | 0,0 |
| Handelsgebäude | 0,0 | 63,0 | 0,0 | 0,0 |
| Industriegebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 225,9 | 191,5 | 0,0 | 0,0 |
| Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bauplätze | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 460,0 | 487,0 | 0,0 | 0,0 |



XII. Aufteilung der Deckungsmasse nach Art der Nutzung

| Frankreich | Gewerblich | | Wohnwirtschaftlich | |
|--|--------------------|--------------|--------------------|------------|
| | Betrag in Mio. EUR | | Betrag in Mio. EUR | |
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Eigentumswohnungen | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Mehrfamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bürogebäude | 449,2 | 477,2 | 0,0 | 0,0 |
| Handelsgebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Industriegebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 8,8 | 9,7 | 0,0 | 0,0 |
| Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bauplätze | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 458,0 | 486,9 | 0,0 | 0,0 |



XII. Aufteilung der Deckungsmasse nach Art der Nutzung

| Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland | Gewerblich | | Wohnwirtschaftlich | |
|--|--------------------|------------|--------------------|------------|
| | Betrag in Mio. EUR | | Betrag in Mio. EUR | |
| | Q1/2026 | Q1/2025 | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Eigentumswohnungen | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Ein- und Zweifamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Mehrfamilienhäuser | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bürogebäude | 55,2 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Handelsgebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Industriegebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Bauplätze | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Summe | 55,2 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |



XIII. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)

| Belegenheit der Grundstückssicherheit | | Gesamtbeträge in Mio. EUR | |
|---------------------------------------|----------|---------------------------|------------|
| Land | Code (*) | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Gesamtsumme | | 0,0 | 0,0 |

XIV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)

| Belegenheit der Grundstückssicherheit | | Gesamtbeträge in Mio. EUR | |
|---------------------------------------|----------|---------------------------|------------|
| Land | Code (*) | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Gesamtsumme | | 0,0 | 0,0 |

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XV. Kennzahlen zur Liquidität

| Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 N. 6 PfandBG | Gesamtbeträge in Mio. EUR | |
|--|---------------------------|---------|
| | Q1/2026 | Q1/2025 |
| Größe sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S.3 PfandBG | 0,0 | -292,6 |
| Am wievielten der nächsten 180 Tage ergibt sich diese größte negative Summe | - | 133,0 |
| Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S.3 PfandBG erfüllen | 231,2 | 306,0 |



XVI. Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung nach § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG

| Q1/2026 | Q1/2025 |
|--------------|--------------|
| ISIN | ISIN |
| DE000DK013Q3 | DE000DK010T3 |
| DE000DK0YUH5 | DE000DK0JTX5 |
| DE000DK0YUS2 | DE000DK0JTZO |
| | DE000DK0YUR4 |
| | XS2517101478 |

| Q1/2026 | Q1/2025 |
|--------------|--------------|
| ISIN | ISIN |
| DE000DK0JTZO | DE000DK011K0 |
| DE000DK0YUR4 | DE000DK0JTY3 |
| XS2689094279 | DE000DK0YUH5 |
| | DE000DK0YUS2 |
| | XS2689094279 |



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

| | | Q1/2026 |
|--|-----------|---------|
| WAL der Deckungsmasse (Total) | in Jahren | 2,3 |
| Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien) | in % | 2,0 |

| Währungspositionen (nominal) | in Mio. EUR | Q1/2026 |
|------------------------------|-------------|---------|
| EUR | | 1.225,9 |
| GBP | | 55,2 |

| Aktuelles Pfandbriefrating (gemäß Ratingagentur) | Q1/2026 |
|--|---------|
| Moody's | Aaa |



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

| Aufteilung der Forderungen gegenüber Zentralbanken und Kreditinstituten i.S.d. § 28 Absatz 1 Nr. 8 und 9 PfandBG nach Bonitätsstufe | in Mio. EUR | Q1/2026 |
|--|--------------------|----------------|
| Bonitätsstufe 1 | | 43,0 |
| Bonitätsstufe 2 | | 201,7 |

| Derivate | | Q1/2026 |
|---|--------------|----------------|
| Sind Derivate in Deckung? | Ja / Nein | Nein |
| Nettobarwert der Derivate in Deckung | in Mio. EUR | 0 |
| Typ der Swap-Kontrahenten (I=Intern, E=Extern, B=Beide, N=None) | (I, E, B, N) | N |



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

| Kredite (*) | | Wohnwirtschaftlich | Gewerblich |
|--|-------------|--------------------|------------|
| | | Q1/2026 | Q1/2026 |
| Anzahl der Kredite | | 0 | 25 |
| Anzahl der Kreditnehmer | | 0 | 32 |
| Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer | in Mio. EUR | 0,0 | 512,5 |
| Anzahl der Objekte | | 0 | 42 |
| Selbstgenutzte Wohnungen in der Deckungsmasse | in Mio. EUR | 0,0 | 0,0 |
| Mehrfamilienhäuser in der Deckungsmasse | in Mio. EUR | 0,0 | 0,0 |

| Kredite (*) | | Q1/2026 |
|---|-------------|----------------------|
| Anteil von "insured mortgages" | in % | 100,0% |
| Sind Versicherungen Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja / Nein | Ja |
| Sind garantierte Kredite in Deckungsmasse enthalten? | Ja / Nein | Nicht anwendbar (**) |
| Anteil garantierter Kredite | in % | Nicht anwendbar (**) |
| Sind "self certified loans" Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja / Nein | Nicht anwendbar (**) |
| Sind "limited certified loans" Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja / Nein | Nicht anwendbar (**) |
| Anteil von "non first lien mortgages" | in % | Nicht anwendbar (**) |
| Sind ABS Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja / Nein | Nicht anwendbar (**) |
| "interest only loans" | in Mio. EUR | 913,4 |

(*) Hinweis: Die Berechnungen beziehen sich nur auf Titel der ordentlichen Deckung.

(**) Hinweis: Nicht anwendbar nach derzeitiger Rechtslage.



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

| Deckungsmasse nach Beleihungsauslauf in Bandbreiten | | | in Mio. EUR | Q1/2026 |
|---|----|-----|-------------|---------|
| > 0% | <= | 20% | | 0,0 |
| > 20% | <= | 30% | | 0,0 |
| > 30% | <= | 40% | | 0,0 |
| > 40% | <= | 50% | | 0,0 |
| > 50% | <= | 60% | | 973,2 |

| Deckungsmasse nach Alter der Kredite in Bandbreiten - seasoning - residential + commercial | | | in Mio. EUR | Q1/2026 |
|--|----|------------|-------------|---------|
| | <= | 12 Monate | | 124,0 |
| 12 Monate | <= | 24 Monate | | 237,5 |
| 24 Monate | <= | 36 Monate | | 1,3 |
| 36 Monate | <= | 60 Monate | | 287,8 |
| 60 Monate | <= | 120 Monate | | 322,6 |
| 120 Monate | > | | | 0,0 |



II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf

| | | Q1/2026 |
|--|------------|---------------------|
| WAL der ausstehenden Darlehen (Total) | in Jahren | 0,8 |
| Sind Soft Bullet Strukturen enthalten? | Ja / Nein | Ja |
| Wenn ja: Ausmaß der Fälligkeitsverschiebung? | in Monaten | 12 |
| Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt? | Ja / Nein | Ja |
| Sind Pass through Strukturen enthalten? | Ja / Nein | Nicht anwendbar (*) |

| Währungspositionen (nominal) | in Mio. EUR | Q1/2026 |
|------------------------------|-------------|---------|
| EUR | | 411,0 |

(*) Hinweis: Nicht anwendbar nach derzeitiger Rechtslage.