

Stichtag	Dez. 2020
Referenz	Dez. 2019

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert*	
	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	6.710	6.326	7.294	6.701	7.942	7.278
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	8.604	7.151	9.649	7.933	10.213	8.346
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Passiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
Überdeckung in %	28,2%	13,1%	32,3%	18,4%	28,6%	14,7%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist bis zu sechs Monate	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	540	15	372	352
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	20	70	516	338
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	500	540	387	294
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	545	20	533	420
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	623	1.045	974	743
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	165	623	1.012	715
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	608	165	891	727
mehr als 10 Jahre	2.628	2.736	3.003	2.698
	1.082	1.112	915	864

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Dez. 20	Dez. 19
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	92,1%	90,4%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	90,5%	89,5%

§ 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	
	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

In der Deckung befinden sich keine Derivate.

\* Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse gem. § 12 PfandBG

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	Dez. 2020	Dez. 2019
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	5.985	5.177
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	1.007	767
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	702	701
mehr als 10 Mio. €	401	321

nach Nutzungsart (I)	Dez. 2020	Dez. 2019
wohnwirtschaftlich	6.532	5.486
gewerblich	1.563	1.480

Land	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	Dez. 20	1.964	3.873	694	164	23	-	1.376	-	-	8.094
	Dez. 19	1.669	3.229	589	11	24	-	1.446	-	-	6.966
<b>Summe</b>	<b>Dez. 20</b>	<b>1.964</b>	<b>3.873</b>	<b>694</b>	<b>164</b>	<b>23</b>	<b>-</b>	<b>1.376</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8.094</b>
	<b>Dez. 19</b>	<b>1.669</b>	<b>3.229</b>	<b>589</b>	<b>11</b>	<b>24</b>	<b>-</b>	<b>1.446</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6.966</b>

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	Dez. 2020		Dez. 2019	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	-	0,0	-	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	5,4		4,7	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,1%		55,4%	
Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	8.094	120,6	6.966	110,1

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Dez. 2020	Dez. 2019
§19 (1) Nr.2 PfandBG	-	-
§19 (1) Nr.3 PfandBG	-	-

§ 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	
	Dez. 2020	Dez. 2019	Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	460	165	460	165
Niederlande	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	50	20	50	20
<b>Summe</b>	-	-	-	-	-	-	<b>510</b>	<b>185</b>	<b>510</b>	<b>185</b>

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag der leistungsgestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019
keine	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-

V) Anhang des Jahresabschlusses

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	Dez. 2020	Dez. 2019	Dez. 2020	Dez. 2019
Anzahl der am Abschluss tag anhängigen Zwangsversteigerungs- und Zwangsverwaltungsverfahren	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten	-	-	-	-
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen	-	-	-	-