

Stichtag	Sep. 2020
Referenz	Sep. 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*	
	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	6.730	5.826	7.321	6.397	8.007	6.976
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	8.299	6.866	9.309	7.746	9.865	8.157
% 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 %	23,3%	17,9%	27,2%	21,1%	23,2%	16,9%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist bis zu sechs Monate	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	45	50	460	307
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	500	535	415	312
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	545	45	455	364
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	611	1.045	999	703
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	167	611	891	728
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	608	167	867	668
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.638	2.246	2.919	2.622
mehr als 10 Jahre	1.082	1.112	871	812

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Sep. 20	Sep. 19
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	91,8%	89,9%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	90,2%	88,6%

§ 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	
	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 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	Sep. 2020	Sep. 2019
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	5.804	4.970
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	953	715
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	688	690
mehr als 10 Mio. €	399	306

nach Nutzungsart (I)	Sep. 2020	Sep. 2019
wohnwirtschaftlich	6.295	5.238
gewerblich	1.550	1.443

Land	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industrie- gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags-fähige Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	Sep. 20	1.874	3.758	662	74	23	-	1.453	-	-	7.844
	Sep. 19	1.602	3.059	577	11	27	-	1.404	-	-	6.681
Summe	Sep. 20	1.874	3.758	662	74	23	-	1.453	-	-	7.844
	Sep. 19	1.602	3.059	577	11	27	-	1.404	-	-	6.681

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	Sep. 2020		Sep. 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	55,2%		55,4%	
Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	7.844	116,6	6.681	114,7

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Sep. 2020	Sep. 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	
			Gesamt		davon gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013					
	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	355	165	355	165
Niederlande	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	100	20	100	20
Summe	-	-	-	-	-	-	455	185	455	185

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG Staat	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag der leistungs-gestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	Sep. 2020	Sep. 2019	Sep. 2020	Sep. 2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-