

Stichtag	Dez. 2019
Referenz	Dez. 2018

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. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	6.326	5.125	6.701	5.250	7.278	5.250
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	7.151	6.218	7.933	6.737	8.346	6.737
% 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 %	13,1%	21,3%	18,4%	28,3%	14,7%	28,3%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018
bis zu sechs Monate	15	415	352	359
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	70	5	338	267
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	540	15	294	304
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20	70	420	290
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.045	560	743	627
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	623	545	715	648
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	165	623	727	613
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.736	1.836	2.698	2.425
mehr als 10 Jahre	1.112	1.057	864	685

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Dez. 19	Dez. 18
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	90,4%	89,4%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	89,5%	96,7%

§ 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. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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. 2019	Dez. 2018
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	5.177	4.453
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	767	608
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	701	567
mehr als 10 Mio. €	321	326

nach Nutzungsart (I)	Dez. 2019	Dez. 2018
wohnwirtschaftlich	5.486	4.648
gewerblich	1.480	1.305

Kennzahlen	Dez. 2019		Dez. 2018	
§ 28 (1) Nr. 7 PfandBG	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Überschreitung der Begrenzung des § 13 (1)	-	0,0	-	0,0
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG	Jahre		Jahre	
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	4,7		4,6	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	55,4%		55,3%	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
Ordentliche Deckung (nominal)	6.966	110,1	5.953	116,2

nach Nutzungsart (II)	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industrie-gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags- fähige Neubaustellen sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Land	Dez. 19	1.669	3.229	589	11	24	-	1.446	-	-	6.966
	Dez. 18	1.413	2.707	527	11	8	-	1.286	-	-	5.953
Summe	Dez. 19	1.669	3.229	589	11	24	-	1.446	-	-	6.966
	Dez. 18	1.413	2.707	527	11	8	-	1.286	-	-	5.953

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Dez. 2019	Dez. 2018
§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					
	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	50	-	-	165	165	165	215
Niederlande	-	-	-	30	-	-	-	-	-	30
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	20	20	20	20
Summe	-	-	-	80	-	-	185	185	185	265

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. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

V) Anhang des Jahresabschlusses

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	Dez. 2019	Dez. 2018	Dez. 2019	Dez. 2018
Anzahl der am Abschlussstag anhängigen Zwangsversteigerungs- und Zwangsverwaltungsverfahren	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	-	-	-	-
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten	-	-	-	-
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen	-	-	-	-