

Stichtag	Mrz. 2020
Referenz	Mrz. 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*	
	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	6.816	5.743	7.332	5.965	7.976	5.965
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	7.455	6.612	8.328	7.284	8.774	7.284
% 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 %	9,4%	15,1%	13,6%	22,1%	10,0%	22,1%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019
bis zu sechs Monate	50	148	325	354
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	535	15	397	329
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	45	86	357	289
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	500	535	373	293
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.050	616	795	666
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	223	1.100	786	699
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	658	238	798	652
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.638	2.324	2.723	2.595
mehr als 10 Jahre	1.117	683	900	736

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Mrz. 20	Mrz. 19
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	90,6%	89,9%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	90,4%	88,4%

§ 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	
	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 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	Mrz. 2020	Mrz. 2019
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	5.387	4.703
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	814	666
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	715	638
mehr als 10 Mio. €	324	341

nach Nutzungsart (I)	Mrz. 2020	Mrz. 2019
wohnwirtschaftlich	5.743	4.942
gewerblich	1.497	1.405

nach Nutzungsart (II)	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	Summe
Land	Mrz. 20	1.758	3.377	608	11	23	-	1.463	-	7.240
	Mrz. 19	1.490	2.883	569	11	22	-	1.371	-	6.347
Summe	Mrz. 20	1.758	3.377	608	11	23	-	1.463	-	7.240
	Mrz. 19	1.490	2.883	569	11	22	-	1.371	-	6.347

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	Mrz. 2020		Mrz. 2019	
§ 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%		55,4%	

Anteil am Gesamtumlauf	Mrz. 2020		Mrz. 2019	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	7.240	106,2	6.347	110,5

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Mrz. 2020	Mrz. 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	
	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019
			Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019				
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	50	-	-	165	165	165	215
Niederlande	-	-	-	30	-	-	-	-	-	30
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	50	20	50	20
Summe	-	-	-	80	-	-	215	185	215	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	
	Mrz. 2020	Mrz. 2019	Mrz. 2020	Mrz. 2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-