

Stichtag	Jun. 2020
Referenz	Jun. 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*	
	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	6.816	5.831	7.406	6.142	8.091	6.142
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	7.821	6.719	8.778	7.500	9.288	7.500
% 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 %	14,7%	15,2%	18,5%	22,1%	14,8%	22,1%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist bis zu sechs Monate	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	540	21	397	328
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	20	100	443	314
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	500	545	363	276
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.093	596	1.020	691
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	190	1.143	770	773
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	648	212	860	622
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.638	3.000	2.741	2.634
mehr als 10 Jahre	1.117	210	846	772

§28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	Jun. 20	Jun. 19
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	91,5%	89,9%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	90,4%	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	
	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 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	Jun. 2020	Jun. 2019
nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	5.651	4.838
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	898	693
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	658	669
mehr als 10 Mio. €	348	334

nach Nutzungsart (I)	Jun. 2020	Jun. 2019
wohnwirtschaftlich	6.072	5.084
gewerblich	1.483	1.450

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 Neubauten sowie Bauplätze	davon Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	Jun. 20	1.820	3.618	634	17	23	-	1.443	-	-	7.556
	Jun. 19	1.558	2.970	556	11	27	-	1.412	-	-	6.534
Summe	Jun. 20	1.820	3.618	634	17	23	-	1.443	-	-	7.556
	Jun. 19	1.558	2.970	556	11	27	-	1.412	-	-	6.534

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Kennzahlen	Jun. 2020		Jun. 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	Jahre		Jahre	
vol.gew. Durchschnitt des Alters der Forderungen	5,3		4,6	
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG	in %		in %	
durchschn. gew. Beleihungsauslauf	57,0%		55,5%	

Anteil am Gesamtumlauf	in Mio. EUR		in %	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Ordentliche Deckung (nominal)	7.556	110,9	6.534	112,1

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerten

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung überschreiten	Jun. 2020	Jun. 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					
	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	-	-	215	165	215	165
Niederlande	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Europäische Institutionen	-	-	-	-	-	-	50	20	50	20
Summe	-	-	-	-	-	-	265	185	265	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 leistungsgestörten Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	Jun. 2020	Jun. 2019	Jun. 2020	Jun. 2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-