

Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 30.09.2020

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

PfandBG § 28 (1) Nr. 1 und 3

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert ¹⁾	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Hypothekendarlehen	5.669,7	5.397,7	6.361,3	6.167,6	6.029,7	5.864,8
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	7.901,9	7.898,5	8.834,1	8.914,7	8.383,4	8.505,9
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	2.232,2	2.500,8	2.472,8	2.747,1	2.353,7	2.641,1
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-

¹⁾ Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. PfandBarwertV verwendet.

Der Ausweis der Nettobarwerte je Fremdwährung entfällt, da der Deckungsmasse ausschließlich Geschäfte auf Euro-Basis zugrundeliegen.

PfandBG § 28 (1) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	Laufzeitenstruktur des Hypothekendarlehens		Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse		davon weitere Deckungswerte	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
<= 0,5 Jahre	222,1	291,1	557,6	496,7	-,-	-,-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	104,5	180,0	380,4	362,1	-,-	-,-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	562,2	221,7	493,2	389,1	-,-	-,-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	105,1	103,8	351,6	392,9	-,-	-,-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	884,0	667,3	657,7	826,4	-,-	-,-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	942,6	884,0	688,7	602,4	-,-	-,-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	465,0	942,6	934,4	673,7	200,0	-,-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.987,8	1.572,8	3.182,1	3.260,1	100,0	300,0
> 10 Jahre	396,5	534,5	656,3	895,3	-,-	-,-

PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	30.09.2020	30.09.2019
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	84,3	83,4
Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	99,1	99,1

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

PfandBG § 28 (2) Nr. 1

Angaben in Mio. EUR

a) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	30.09.2020	30.09.2019
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	2.455,4	2.682,1
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.553,6	1.513,1
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.668,4	2.580,2
Mehr als 10 Mio. EUR	924,5	823,2

b) und c) Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen nach Nutzungsart und nach Staaten²⁾

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Eigentumswohnungen	700,2	728,2	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	1.878,1	1.993,9	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.663,8	2.574,9	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	1.047,9	970,4
Handelsgebäude	-,-	-,-	246,0	288,5
Industriegebäude	-,-	-,-	168,4	169,3
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	897,5	873,3
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

²⁾ keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	30.09.2020	30.09.2019
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) überschreiten (in Mio. EUR)	0,0	0,0
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (in Jahren)	6,9	6,7

PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	30.09.2020	30.09.2019
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)	52,4	52,3

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	30.09.2020	30.09.2019
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 2 übersteigen	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 (1) Nr. 3 übersteigen	0,0	0,0

PfandBG § 28 (1) Nr. 4, 5 und 6

	30.09.2020	30.09.2019
Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2	0,0	0,0
<i>davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d.Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013</i>	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 3	300,0	300,0

IV) Übersicht der rückständigen Leistungen

PfandBG § 28 (2) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	30.09.2020	30.09.2019
Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen	0,0	0,0
Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	0,0	0,0