

Informationen zum Deckungsstock gemäß § 28 PfandBG per 30.06.2021

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

PfandBG § 28 (1) Nr. 1 und 3

Angaben in Mio. EUR

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert ¹⁾	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
Hypothekendarlehen	6.524,1	5.713,2	7.083,4	6.423,5	6.768,9	6.084,4
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	8.123,5	7.729,8	8.879,3	8.629,5	8.497,2	8.216,7
<i>davon Derivategeschäfte</i>	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	1.599,4	2.016,6	1.795,9	2.206,0	1.728,3	2.132,3
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	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
<= 0,5 Jahre	49,7	91,6	995,5	459,3
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	610,0	226,0	559,6	476,1
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	262,1	39,7	266,0	287,5
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	611,0	610,0	428,2	557,3
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	708,6	883,1	697,1	702,2
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.149,0	708,6	806,8	625,8
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.013,0	672,0	796,5	882,3
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.849,8	2.080,8	2.974,6	3.078,5
> 10 Jahre	271,0	401,5	599,2	660,7

PfandBG § 28 (1) Nr. 9

Angaben in %

	30.06.2021	30.06.2020
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	82,0	83,9
Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	99,7	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	30.06.2021	30.06.2020
Bis einschließlich 300 Tsd. EUR	2.382,8	2.460,8
Mehr als 300 Tsd. EUR bis einschließlich 1 Mio. EUR	1.566,4	1.515,4
Mehr als 1 Mio. EUR bis einschließlich 10 Mio. EUR	2.534,7	2.639,9
Mehr als 10 Mio. EUR	1.039,6	813,7

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

	wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke		gewerblich genutzte Grundstücke	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
Eigentumswohnungen	703,9	687,4	-,-	-,-
Ein- und Zweifamilienhäuser	1.822,2	1.860,1	-,-	-,-
Mehrfamilienhäuser	2.650,0	2.596,8	-,-	-,-
Bürogebäude	-,-	-,-	1.040,6	961,5
Handelsgebäude	-,-	-,-	249,0	273,7
Industriegebäude	-,-	-,-	184,4	166,3
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	-,-	-,-	873,4	884,1
Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	-,-	-,-	-,-	-,-
Bauplätze	-,-	-,-	-,-	-,-

²⁾ keine Grundstückssicherheiten außerhalb Deutschlands

PfandBG § 28 (1) Nr. 7 und 11

	30.06.2021	30.06.2020
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)	7,2	7,0

PfandBG § 28 (2) Nr. 3

	30.06.2021	30.06.2020
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf (in %)	52,0	52,4

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

PfandBG § 28 (1) Nr. 8

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2021	30.06.2020
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

	30.06.2021	30.06.2020
Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2	500,0	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	100,0	300,0

IV) Übersicht der rückständigen Leistungen

PfandBG § 28 (2) Nr. 2

Angaben in Mio. EUR

	30.06.2021	30.06.2020
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