

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
2. Quartal 2020

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2020	Q2 2019	Q2 2020	Q2 2019	Q2 2020	Q2 2019
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	10,0	-	10,2	-	8,0	-
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	39,4	-	46,9	-	39,1	-
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	29,4	-	36,7	-	31,1	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		293,9	-	359,9	-	387,7	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der statische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 PfandBarwertV verwendet.

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
2. Quartal 2020

Hypothekendarfandbriefe	Q2 2020		Q2 2019	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	0,1	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	0,2	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	0,4	-	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	0,2	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	1,9	-	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	2,7	-	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	1,2	-	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	10,0	29,3	-	-
> 10 Jahre	-	3,5	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG, § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG und § 28 Abs. 4 Nr. 1 a PfandBG

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen
2. Quartal 2020

Deckungswerte	Q2 2020 Mio. €	Q2 2019 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	34,4	-
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	1,0	-
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	-	-
Mehr als 10 Mio. €	-	-
Summe	35,4	-

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

2. Quartal 2020

		Deckungswerte														Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	2. Quartal	Insgesamt		Wohnwirtschaftlich						Gewerblich							
		davon		Insgesamt						davon							
		Mio. €	Mio. €	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze	Insgesamt	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	35,4	35,4	7,0	28,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	35,4	35,4	7,0	28,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen

2. Quartal 2020

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen nach § 19 Abs. 1 Nr.1, Nr. 2 und 3 PfandBG						
Staat	2. Quartal	Summe Mio. €	davon		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2 Insgesamt Mio. €	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3 Mio. €
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1 Mio. €			
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	4,0	-	-	-	4,0
	Jahr 2019	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	-	-	-	-	-
Lettland	Jahr 2020	1,0	-	-	-	1,0
	Jahr 2019	-	-	-	-	-
Litauen	Jahr 2020	1,0	-	-	-	1,0
	Jahr 2019	-	-	-	-	-
Slowenien	Jahr 2020	2,0	-	-	-	2,0
	Jahr 2019	-	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

2. Quartal 2020

Hypothekendarlehen			
		Q2 2020	Q2 2019
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	10,0	-
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,0	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	39,4	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten § 28 Abs. 1 Nr. 7	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,0	-
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
AUD	-	-	
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 1 Nr. 11	Jahre	1,1	-
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	55,6	-
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-