



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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

3. Quartal 2020

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2020	Q3 2019	Q3 2020	Q3 2019	Q3 2020	Q3 2019
Hypothekendarlehen	(Mio. €)	6,0	-	6,1	-	5,6	-
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	567,6	-	650,4	-	516,1	-
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	561,6	-	644,3	-	510,5	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		9.360,8	-	10.489,4	-	9.089,5	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	561,6	-	644,3	-		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		9.360,8	-	10.489,4	-		

* 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

3. Quartal 2020

Hypothekendarfandbriefe	Q3 2020		Q3 2019	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	2,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	3,1	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	3,2	-	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	3,3	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	15,6	-	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	5,0	26,9	-	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1,0	11,9	-	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	297,9	-	-
> 10 Jahre	-	202,9	-	-

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

Deckungswerte	Q3 2020 Mio. €	Q3 2019 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	473,0	-
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	43,7	-
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	-	-
Mehr als 10 Mio. €	-	-
Summe	516,6	-

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.

3. 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	3. Quartal	Insgesamt							Gewerblich								
		davon							davon								
		Wohnwirtschaftlich							Insgesamt								
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	516,6	514,4	96,8	403,1	14,5	-	-	2,2	-	-	-	-	2,2	-	-	-
	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	516,6	514,4	96,8	403,1	14,5	-	-	2,2	-	-	-	-	2,2	-	-	-
	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen

3. Quartal 2020

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen nach § 19 Abs. 1 Nr.1, Nr. 2 und 3 PfandBG						
Staat	3. 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. €	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	51,0	-	-	-	51,0
	Jahr 2019	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	51,0	-	-	-	51,0
	Jahr 2019	-	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

3. Quartal 2020

Hypothekendarlehen		Q3 2020	Q3 2019
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	6,0	-
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,0	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	567,6	-
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	1,3	-
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	51,3	-
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-