DSK Hyp AG

DSK Hyp AG
Stephanstraße 14 - 16
60313 Frankfurt am Main
Telefon: +49 69 668196 - 0
Telefax: +49 69 668196 - 7444
E-Mail: information@dskhyp.de
Internet: www.dskhyp.de

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

2. Quartal 2021

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2021	Q2 2020	Q2 2021	Q2 2020	Q2 2021	Q2 2020
Hypothekenpfandbriefe	(Mio. €)	142,5	213,0	162,7	254,2	158,2	236,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	462,8	910,6	481,6	946,2	472,2	922,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	320,3	697,6	318,9	692,0	313,9	685,7
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		224,8	327,5	196,1	272,2	198,4	289,6
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	320,3	697,6	318,9	692,0		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		224,8	327,5	196,1	272,2		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2021	Q2 2020	Q2 2021	Q2 2020	Q2 2021	Q2 2020
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	57,5	70,5	67,5	84,2	65,9	79,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	162,3	291,9	169,3	305,0	165,6	297,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	104,8	221,4	101,8	220,8	99,7	217,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		182,3	314,1	150,7	262,4	151,4	273,2
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	104,8	221,4	101,8	220,8		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		182,3	314,1	150,7	262,4		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

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

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
2. Quartal 2021

Hypothekenpfandbriefe	Q2 2021		Q2 2020	
Restlaufzeit:	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €
<= 0,5 Jahre	35,0	88,1	-	197,0
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1,0	86,5	5,0	215,3
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	12,5	50,5	35,0	90,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	54,5	1,0	89,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	58,0	20,9	17,5	155,6
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	16,0	130,6	59,5	0,9
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	5,0	31,7	70,0	130,6
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	15,0	-	25,0	31,4
> 10 Jahre	-	-	-	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q2 2021		Q2 2020	
Restlaufzeit:	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €
<= 0,5 Jahre	5,0	5,5	13,0	42,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	0,0	-	15,4
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	5,0	31,3	5,0	6,7
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	2,0	0,0	-	0,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	35,0	85,1	7,0	47,5
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	40,3	35,0	116,3
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	-	-	63,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	10,5	-	10,5	-
> 10 Jahre	-	-	-	-

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 Hypothekenpfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
2. Quartal 2021

Deckungswerte	Q2 2021 Mio. €	Q2 2020 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	0,5	1,0
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	2,4	6,4
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	65,5	159,5
Mehr als 10 Mio. €	354,5	693,7
Summe	422,8	860,6

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
2. Quartal 2021

Deckungswerte	Q2 2021 Mio. €	Q2 2020 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	36,1	76,6
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	126,3	215,3
Mehr als 100 Mio. €	-	-
Summe	162,3	291,9

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 b, c und Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Hypothekenpfandbriefen 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 2021

		Deckungswerte														**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen**	**Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt**
		Insgesamt	davon														
			Wohnwirtschaftlich						**Gewerblich**								
			Insgesamt	davon					**Insgesamt**	davon							
				Eigentums-wohnungen	**Ein- und Zwei-familien-häuser**	**Mehrfamilien-häuser**	**Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten**	**Bauplätze**		**Bürogebäude**	**Handels-gebäude**	**Industrie-gebäude**	**Sonstige gewerblich genutzte Gebäude**	**Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten**	**Bauplätze**		
Staat	**2. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2021	422,8	259,4	-	-	259,4	-	-	163,4	68,0	45,1	-	50,3	-	-	-	-
	Jahr 2020	860,6	316,8	4,8	-	312,0	-	-	543,7	258,4	217,1	-	68,3	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2021	398,8	259,4	-	-	259,4	-	-	139,4	44,0	45,1	-	50,3	-	-	-	-
	Jahr 2020	663,6	316,8	4,8	-	312,0	-	-	346,8	140,3	138,3	-	68,3	-	-	-	-
Finnland	Jahr 2021	24,0	-	-	-	-	-	-	24,0	24,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2020	128,8	-	-	-	-	-	-	128,8	58,6	70,2	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2020	68,1	-	-	-	-	-	-	68,1	59,6	8,6	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

2. Quartal 2021

		Deckungswerte									
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper-schaften	Örtliche Gebietskörper-schaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper-schaften	Örtliche Gebietskörper-schaften	Sonstige
Staat	**2. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2021	162,3	-	25,0	70,0	-	0,6	-	61,3	5,5	-
	Jahr 2020	291,9	-	35,0	130,0	9,7	0,7	-	110,3	6,3	-
Deutschland	Jahr 2021	162,3	-	25,0	70,0	-	0,6	-	61,3	5,5	-
	Jahr 2020	282,2	-	35,0	130,0	-	0,7	-	110,3	6,3	-
Finnland	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2020	9,7	-	-	-	9,7	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
2. Quartal 2021

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper-schaften	Örtliche Gebietskörper-schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper-schaften	Örtliche Gebietskörper-schaften	Sonstige
Staat	**2. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 6 PfandBG

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekenpfandbriefe

2. Quartal 2021

		Weitere Deckungswerte für Hypothekenpfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr.1, Nr. 2 und 3 PfandBG				
		Summe	davon			
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	**Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2**		**Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3**
				Insgesamt	davon	
					gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Staat	**2. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2021	40,0	-	-	-	40,0
	Jahr 2020	50,0	-	-	-	50,0
Deutschland	Jahr 2021	40,0	-	-	-	40,0
	Jahr 2020	50,0	-	-	-	50,0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 7, 8, 9, 10 und 11 PfandBG und § 28 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
2. Quartal 2021

Hypothekenpfandbriefe

		Q2 2021	Q2 2020
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	142,5	213,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	94,7	94,1
Deckungsmasse	(Mio. €)	462,8	910,6
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	%	81,2	65,3
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	-	69,0
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 1 Nr. 11	Jahre	7,1	7,2
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	54,6	54,4
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-

Öffentliche Pfandbriefe

		Q2 2021	Q2 2020
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	57,5	70,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,0	100,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	162,3	291,9
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 20 Abs. 2 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	81,5	72,7
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	-	-