

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

Umlaufende Hypothekendarfbriefe und dafür verwendete Deckungswerte | 30.06.2022

	Nominalwert	Barwert	Risikobarwert*
	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen			
Hypothekendarfbriefe	16.063,6	15.967,7	16.552,1
davon Derivate	-	-	-
Deckungsmasse	18.649,3	18.955,1	19.172,4
davon Derivate	-	-	-
Überdeckung	2.585,7	2.987,4	2.620,3
Überdeckung in % vom Darfbrief-Umlauf	16,1%	18,7%	15,8%
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	2.858,7	2.987,4	
Überdeckung in % vom Darfbrief-Umlauf	16,1%	18,7%	

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

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 DarfBG

Laufzeitstruktur der umlaufenden Hypothekendarfbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen

Restlaufzeit:	Pdarfbriefumlauf	Deckungsmasse
	Mio. €	Mio. €
<= 0,5 Jahre	848,0	3.346,9
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.980,5	1.281,0
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	947,8	1.902,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	3.011,4	1.154,2
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.901,8	2.450,9
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.816,5	2.403,4
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	981,8	1.903,2
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.121,1	3.955,6
> 10 Jahre	2.454,7	251,9
Summe	16.063,6	18.649,3

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

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarbriefe - Detaildarstellung | 30.06.2022

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr.1, Nr. 2 und Nr.3					
	Insgesamt	davon			
		Ausgleichsforderungen nach § 19 Abs. 1 Nr. 1	Geldforderungen nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 mit Ausnahme der Werte im Sinne des §4 Abs. 1 Satz2 Nr. 1 und 2		Schuldverschreibungen nach § 19 Abs. 1 Nr. 3
			Insgesamt	davon	
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	732,2	-	635,8	-	96,4
Belgien	-	-	-	-	-
Deutschland	600,0	-	600,0	-	-
Italien	80,0	-	-	-	80,0
Luxemburg	35,8	-	35,8	-	-
Niederlande	-	-	-	-	-
Österreich	2,0	-	-	-	2,0
Slowenien	-	-	-	-	-
Spanien	14,4	-	-	-	14,4
USA	-	-	-	-	-
Internationale Organisationen	-	-	-	-	-

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

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die belehnten Grundstücke liegen und nach Nutzungsart

sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der jeweiligen Forderung beträgt. | 30.06.2022

	Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
	Summe	davon							Summe	davon								
		Wohnwirtschaftlich								Summe	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze		
		Summe	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze											
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	17.917,1	3.059,3	379,7	2,7	2.562,2	114,7	-	14.857,8	8.954,1	2.124,5	192,1	2.803,8	704,8	78,4	-	-		
Deutschland	7.593,2	2.540,2	322,2	2,6	2.100,6	114,7	-	5.052,9	2.847,1	723,8	69,4	776,6	557,5	78,4	-	-		
Belgien	80,9	-	-	-	-	-	-	80,9	80,9	-	-	-	-	-	-	-		
Frankreich	2.094,4	-	-	-	-	-	-	2.094,4	1.513,5	148,9	-	284,7	147,3	-	-	-		
Großbritannien	1.391,2	-	-	-	-	-	-	1.391,2	456,7	341,9	23,3	569,3	-	-	-	-		
Niederlande	558,8	103,3	57,5	-	45,8	-	-	455,5	233,3	-	-	222,2	-	-	-	-		
Österreich	194,2	0,0	-	0,0	-	-	-	194,1	51,8	77,0	-	65,3	-	-	-	-		
Schweiz	45,6	-	-	-	-	-	-	45,6	45,6	-	-	-	-	-	-	-		
USA	3.262,8	387,4	-	-	387,4	-	-	2.875,5	2.480,4	17,7	39,3	338,1	-	-	-	-		
Dänemark	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
Finnland	203,0	-	-	-	-	-	-	203,0	117,7	85,3	-	-	-	-	-	-		
Italien	51,1	-	-	-	-	-	-	51,1	36,8	-	-	14,3	-	-	-	-		
Luxemburg	49,8	-	-	-	-	-	-	49,8	23,1	-	-	26,8	-	-	-	-		
Polen	908,7	-	-	-	-	-	-	908,7	437,5	268,5	15,4	187,4	-	-	-	-		
Schweden	603,3	28,4	-	-	28,4	-	-	575,0	290,6	135,0	-	149,4	-	-	-	-		
Slowakei	88,4	-	-	-	-	-	-	88,4	-	22,0	-	66,4	-	-	-	-		
Spanien	206,4	-	-	-	-	-	-	206,4	75,3	85,3	-	45,7	-	-	-	-		
Tschechien	258,1	-	-	-	-	-	-	258,1	75,7	92,4	44,8	45,2	-	-	-	-		
Ungarn	139,5	-	-	-	-	-	-	139,5	78,2	49,0	-	12,4	-	-	-	-		
Rumänien	143,4	-	-	-	-	-	-	143,4	110,1	33,3	-	-	-	-	-	-		
Slowenien	44,4	-	-	-	-	-	-	44,4	-	44,4	-	-	-	-	-	-		

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen | 30.06.2022

	Deckungswerte
	Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	57,3
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	121,8
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	1.191,9
Mehr als 10 Mio. €	16.546,0
Summe	17.917,1

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

Kennzahlen zu Hypothekendarlehen und dafür verwendeter Deckungswerte | 30.06.2022

	Deckungswerte
	Mio. €
Umlaufende Hypothekendarlehen	16.063,6
davon Anteil festverzinslicher Darlehen (§ 28 Abs. 1 Nr. 9)	86,49%
Deckungsmasse	18.649,3
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Nr. 7)	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Nr. 8)	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Nr. 8)	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse (§ 28 Abs. 1 Nr. 9)	56,40%
	CHF 61,1
	GBP 324,8
	SEK 251,1
	USD 1.214,2
Nettobarwert nach § 6 Abs. 1 Darlehen- Barwertverordnung je Fremdwährung in Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning) in Jahren (§ 28 Abs. 1 Nr. 11)	3,4
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf (§ 28 Abs. 2 Nr. 3)	56,01%
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	32,34%

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

Umlaufende öffentliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte | 30.06.2022

	Nominalwert	Barwert	Risikobarwert*
	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen			
öffentlichen Pfandbriefe	9.810,4	10.797,9	9.693,8
davon Derivate	-	-	-
Deckungsmasse	11.014,0	12.113,1	10.394,2
davon Derivate	-	-	-
Überdeckung	1.203,6	1.315,2	700,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	12,3%	12,2%	7,2%
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	1.203,6	1.315,2	
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	12,3%	12,2%	

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

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG

Laufzeitstruktur der umlaufenden öffentlichen Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen

Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
	Mio. €	Mio. €
< = 0,5 Jahre	195,1	363,4
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	351,8	373,8
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	502,4	345,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	605,5	402,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	685,6	507,8
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	782,1	518,4
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	744,5	780,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.901,8	3.047,7
> 10 Jahre	3.041,5	4.675,2
Summe	9.810,4	11.014,0

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

Weitere Deckungswerte für öffentliche Pfandbriefe - Detaildarstellung | 30.06.2022

	Weitere Deckungswerte für öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2			
	Insgesamt	davon	Geldforderungen nach § 20 Abs. 2 Nr. 2	
			Insgesamt	davon
		Ausgleichsforderungen nach § 20 Abs. 2 Nr. 1		gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	-	-	-	-
Deutschland	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen | 30.06.2022

	Deckungswerte										
	Summe			davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		In dieser Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	11.014,0	429,5	3.703,3	3.135,1	934,5	1.383,6	903,3	626,9	261,0	66,3	
Deutschland	2.900,0	288,1	189,6	1.877,3	66,5	276,2	292,6	129,4	68,5	-	
Belgien	104,0	-	-	-	-	-	50,0	54,0	-	-	
Finnland	54,1	-	9,6	-	-	24,5	-	-	-	-	
Frankreich	2.583,4	17,4	163,3	804,9	631,3	672,0	118,7	57,7	135,5	-	
Luxemburg	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Italien	202,6	-	-	193,2	9,5	-	-	-	-	-	
Japan	225,7	-	165,7	-	60,0	-	-	-	-	-	
Litauen	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Niederlande	55,0	55,0	-	-	-	-	55,0	-	0,1	-	
Österreich	3.867,8	-	3.175,0	-	-	-	370,0	265,8	57,0	-	
Portugal	300,0	-	-	-	-	180,0	-	120,0	-	-	
Schweden	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Slowakei	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Spanien	281,3	-	-	248,0	-	33,3	-	-	-	-	
Schweiz	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Slowenien	14,3	-	-	-	-	-	14,3	-	-	-	
Tschechien	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Kanada	66,3	66,3	-	-	-	-	-	-	-	66,3	
Großbritannien	161,7	2,8	-	11,7	147,3	-	2,8	-	-	-	
USA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Internationale Organisationen	197,6	-	-	-	-	197,6	-	-	-	-	

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der jeweiligen Forderung beträgt

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					
Summe	davon				
	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige	
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	-	-	-	-	-
Deutschland	-	-	-	-	-

Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt					
Summe	davon				
	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige	
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	-	-	-	-	-
Deutschland	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen | 30.06.2022

	Deckungswerte
	Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	351,8
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	3.424,2
Mehr als 100 Mio. €	7.238,0
Summe	11.014,0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 8, 9, und 10 PfandBG

Kennzahlen zu öffentlichen Pfandbriefen und dafür verwendeter Deckungswerte | 30.06.2022

	Deckungswerte
	Mio. €
Umlaufende öffentliche Pfandbriefe	9.810,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	71,18%
Deckungsmasse	11.014,0
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	73,33%
	CAD
	15,1
	CHF
	58,1
	GBP
	240,4
	JPY
	208,8
	USD
	510,1

Nettobarwert nach § 6 Abs. 1 Pfandbrief-
Barwertverordnung je Fremdwährung in Euro
§ 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)