



Deckungsregister-Report gem. § 28 PfandBG

3. Quartal 2020

| | Seite |
|---|--------------|
| • Nominal- und Barwertdeckung sowie Derivateanteil | 3 |
| • Laufzeitstruktur | 4 |
| • Deckungsmasse nach Größenklassen | 5 |
| • Hypothekenpfandbriefe - Deckungsmasse nach Nutzungsart und Regionen sowie Leistungsrückstände | 6 |
| • Öffentliche Pfandbriefe - Deckungsmasse nach Schuldner und Regionen | 7 |
| • Öffentliche Pfandbriefe - Leistungsrückstände | 8 |
| • Weitere Deckung | 9 |
| • Hypothekenpfandbriefe - Kennzahlen | 10 |
| • Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen | 11 |



Nominal- und Barwertdeckung sowie Derivateanteil (§ 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG)

3

| Hypothekendarlehen | Nominalwert | | Barwert | | Risikobarwert Internes Modell | | |
|-----------------------------|-------------|----------|----------|----------|----------------------------------|---------|---------|
| | Mio. € | Q3 2020 | Q3 2019 | Q3 2020 | Q3 2019 | Q3 2020 | Q3 2019 |
| Pfandbrief-Umlauf | | 12.142,1 | 11.123,5 | 12.396,5 | 11.380,0 | -- | -- |
| davon Derivate | | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Deckungsmasse | | 17.629,0 | 15.296,1 | 18.865,7 | 16.375,1 | -- | -- |
| davon Derivate | | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Überdeckung | | 5.486,9 | 4.172,6 | 6.469,2 | 4.995,1 | 5.603,8 | 4.529,6 |
| Überdeckung in % vom Umlauf | | 45,2 | 37,5 | 52,2 | 43,9 | 45,2 | 39,8 |

| Öffentliche Pfandbriefe | Nominalwert | | Barwert | | Risikobarwert Internes Modell | | |
|-----------------------------|-------------|----------|----------|----------|----------------------------------|---------|---------|
| | Mio. € | Q3 2020 | Q3 2019 | Q3 2020 | Q3 2019 | Q3 2020 | Q3 2019 |
| Pfandbrief-Umlauf | | 28.318,7 | 28.172,4 | 33.321,4 | 35.022,9 | -- | -- |
| davon Derivate | | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Deckungsmasse | | 32.993,8 | 34.197,4 | 40.203,2 | 42.330,5 | -- | -- |
| davon Derivate | | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Überdeckung | | 4.675,1 | 6.025,0 | 6.881,8 | 7.307,6 | 6.171,7 | 6.453,6 |
| Überdeckung in % vom Umlauf | | 16,5 | 21,4 | 20,7 | 20,9 | 18,5 | 18,4 |

Die Helaba beteiligt sich am vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell. Nach diesem Modell besteht keine Notwendigkeit, Anpassungen der Deckungsmasse vorzunehmen.



Laufzeitstruktur

(§ 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG)

4

| Restlaufzeit | Hypothekendarfandbriefe | | | |
|-----------------------|-------------------------|-----------------|-------------------|-----------------|
| | Q3 2020 | | Q3 2019 | |
| Mio. € | Pfandbrief-Umlauf | Deckungsmasse | Pfandbrief-Umlauf | Deckungsmasse |
| ≤ 0,5 Jahre | 2.125,3 | 1.402,0 | 1.063,3 | 984,2 |
| > 0,5 Jahre ≤ 1 Jahr | 937,4 | 1.903,9 | 561,0 | 717,6 |
| > 1 Jahr ≤ 1,5 Jahre | 2.139,2 | 845,1 | 2.158,9 | 1.197,6 |
| > 1,5 Jahre ≤ 2 Jahre | 1.130,0 | 1.136,8 | 943,8 | 837,3 |
| > 2 Jahre ≤ 3 Jahre | 1.575,2 | 2.433,2 | 2.263,0 | 2.215,4 |
| > 3 Jahre ≤ 4 Jahre | 1.798,0 | 2.869,0 | 1.088,5 | 2.193,7 |
| > 4 Jahre ≤ 5 Jahre | 2.260,0 | 2.041,9 | 1.868,0 | 1.870,9 |
| > 5 Jahre ≤ 10 Jahre | 77,0 | 4.820,4 | 1.077,0 | 5.151,4 |
| > 10 Jahre | 100,0 | 176,7 | 100,0 | 128,0 |
| Summe | 12.142,1 | 17.629,0 | 11.123,5 | 15.296,1 |

| Restlaufzeit | Öffentliche Darfandbriefe | | | |
|-----------------------|---------------------------|-----------------|-------------------|-----------------|
| | Q3 2020 | | Q3 2019 | |
| Mio. € | Pfandbrief-Umlauf | Deckungsmasse | Pfandbrief-Umlauf | Deckungsmasse |
| ≤ 0,5 Jahre | 1.211,2 | 2.056,6 | 2.234,4 | 1.690,6 |
| > 0,5 Jahre ≤ 1 Jahr | 2.098,2 | 1.320,4 | 869,9 | 1.644,3 |
| > 1 Jahr ≤ 1,5 Jahre | 1.301,1 | 1.184,7 | 1.125,6 | 1.578,2 |
| > 1,5 Jahre ≤ 2 Jahre | 2.357,7 | 1.233,7 | 2.100,0 | 1.480,1 |
| > 2 Jahre ≤ 3 Jahre | 4.259,9 | 3.741,0 | 3.624,5 | 2.603,6 |
| > 3 Jahre ≤ 4 Jahre | 2.648,3 | 2.374,7 | 3.278,4 | 3.551,7 |
| > 4 Jahre ≤ 5 Jahre | 1.542,7 | 1.732,1 | 1.207,5 | 2.304,7 |
| > 5 Jahre ≤ 10 Jahre | 8.283,0 | 9.929,9 | 8.594,1 | 10.012,7 |
| > 10 Jahre | 4.616,6 | 9.420,7 | 5.138,0 | 9.331,5 |
| Summe | 28.318,7 | 32.993,8 | 28.172,4 | 34.197,4 |



Größenklassen

(§ 28 Abs. 2 Nr. 1 a) und § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG)

| Hypothekendarfandbriefe | Deckungswerte | | | |
|-------------------------|-----------------|--------------|-----------------|--------------|
| | Q3 2020 | | Q3 2019 | |
| | Mio. € | % | Mio. € | % |
| ≤ 0,3 Mio. € | 608,9 | 3,5 | 419,0 | 2,7 |
| > 0,3 Mio. € ≤ 1 Mio. € | 167,2 | 0,9 | 134,9 | 0,9 |
| > 1 Mio. € ≤ 10 Mio. € | 953,3 | 5,4 | 1.115,3 | 7,3 |
| > 10 Mio. € | 14.298,8 | 81,1 | 13.181,9 | 86,2 |
| Weitere Deckung | 1.600,8 | 9,1 | 445,0 | 2,9 |
| Summe | 17.629,0 | 100,0 | 15.296,1 | 100,0 |

| Öffentliche Darfandbriefe | Deckungswerte | | | |
|---------------------------|-----------------|--------------|-----------------|--------------|
| | Q3 2020 | | Q3 2019 | |
| | Mio. € | % | Mio. € | % |
| ≤ 10 Mio. € | 3.781,8 | 11,5 | 5.154,4 | 15,1 |
| > 10 Mio. € ≤ 100 Mio. € | 8.585,2 | 26,0 | 11.075,6 | 32,4 |
| > 100 Mio. € | 20.489,3 | 62,1 | 17.815,0 | 52,1 |
| Weitere Deckung | 137,5 | 0,4 | 152,4 | 0,4 |
| Summe | 32.993,8 | 100,0 | 34.197,4 | 100,0 |



Hypothekendarfandbriefe - Deckungsmasse nach Nutzungsart und Land sowie Leistungsrückstände (§ 28 Abs. 2 Nr. 1 b), c) und Nr. 2 PfandBG)

6

Hypotheken-Pfandbriefe Deckungswerte

| Nutzungsart | Land | Q3 | Insgesamt Mio. € | Davon | | | | | | | | | | | | Leistungs- rückstände > 90 Tage Mio. € | Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der Rückstand mind. 5% der Forderung beträgt Mio. € |
|----------------|-------------|-----------------|---------------------|---------------------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|---|--------------------------|---------------------|----------------------------|-------------------------------|---------------------------------|---|---|---|---|
| | | | | Wohnwirtschaftlich | | | | | | Gewerblich | | | | | | | |
| | | | | Insgesamt Mio. € | Eigentums- wohnungen Mio. € | Ein- und Zwei- familien- häuser Mio. € | Mehrfamilien- häuser Mio. € | Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten Mio. € | Bau- plätze Mio. € | Insgesamt Mio. € | Büro- gebäude Mio. € | Handels- gebäude Mio. € | Industrie- gebäude Mio. € | Sonstige gewerblich genutzte Gebäude Mio. € | Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten Mio. € | | |
| Deutschland | 2020 | 8.374,8 | 2.791,7 | 161,8 | 437,6 | 2.191,7 | 0,5 | 0,1 | 5.583,1 | 2.667,2 | 2.434,1 | 199,8 | 223,8 | 56,1 | 2,1 | 0,0 | 0,0 |
| | 2019 | 8.074,0 | 2.415,6 | 114,4 | 252,0 | 2.048,8 | 0,0 | 0,4 | 5.658,4 | 2.450,4 | 2.227,9 | 166,7 | 752,5 | -- | 60,9 | 0,0 | 0,0 |
| Belgien | 2020 | 107,8 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 107,8 | 107,8 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 112,5 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 112,5 | 112,5 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Finnland | 2020 | 303,9 | 12,2 | -- | -- | 12,2 | -- | -- | 291,7 | 115,8 | 175,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 140,2 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 140,2 | 59,4 | 33,6 | -- | 47,2 | -- | -- | -- | -- |
| Frankreich | 2020 | 761,2 | 16,0 | -- | -- | 16,0 | -- | -- | 745,2 | 585,3 | 159,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 838,0 | 16,0 | -- | -- | 16,0 | -- | -- | 822,0 | 670,2 | 115,4 | -- | 36,4 | -- | -- | -- | -- |
| Großbritannien | 2020 | 1.032,4 | 11,3 | -- | -- | 11,3 | -- | -- | 1.021,1 | 715,5 | 304,8 | -- | 0,8 | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 938,1 | 8,0 | -- | -- | 8,0 | -- | -- | 930,1 | 627,4 | 188,6 | -- | 114,1 | -- | -- | -- | -- |
| Luxemburg | 2020 | 192,1 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 192,1 | 192,1 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 81,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 81,9 | 81,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Niederlande | 2020 | 504,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 504,3 | 289,9 | 193,2 | -- | 14,6 | 6,6 | -- | -- | -- |
| | 2019 | 283,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 283,3 | 107,2 | 176,1 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Norwegen | 2020 | 57,8 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 57,8 | 57,8 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 64,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 64,9 | 64,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Österreich | 2020 | 120,4 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 120,4 | 85,5 | 34,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 164,6 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 164,6 | 57,9 | 106,7 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Polen | 2020 | 1.114,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 1.114,3 | 479,4 | 634,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 1.029,6 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 1.029,6 | 515,0 | 514,6 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Schweden | 2020 | 226,1 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 226,1 | 112,8 | 113,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 245,8 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 245,8 | 84,8 | 103,9 | -- | 57,1 | -- | -- | -- | -- |
| Tschechien | 2020 | 122,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 122,3 | 70,0 | 52,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 69,0 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 69,0 | 16,7 | 52,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| USA | 2020 | 3.110,8 | 1.308,1 | -- | -- | 1.308,1 | -- | -- | 1.802,7 | 1.681,0 | 121,7 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 2.809,2 | 1.163,3 | -- | -- | 1.163,3 | -- | -- | 1.645,9 | 1.525,6 | 120,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Gesamt | 2020 | 16.028,2 | 4.139,3 | 161,8 | 437,6 | 3.539,3 | 0,5 | 0,1 | 11.888,9 | 7.160,1 | 4.225,0 | 199,8 | 239,2 | 62,7 | 2,1 | 0,0 | 0,0 |
| | 2019 | 14.851,1 | 3.602,9 | 114,4 | 252,0 | 3.236,1 | 0,0 | 0,4 | 11.248,2 | 6.373,9 | 3.639,4 | 166,7 | 1.007,3 | 0,0 | 60,9 | 0,0 | 0,0 |



Öffentliche Pfandbriefe - Deckungsmasse nach Schuldner und Land

(§ 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG)

7

| Schuldner | | Summe | In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderu. | Davon geschuldet von | | | | Davon gewährleistet von | | | |
|----------------|------|----------|---|----------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------|
| | | | | Zentralstaat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige Schuldner | Zentralstaat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige Schuldner |
| Land | Q3 | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € |
| Deutschland | 2020 | 30.384,7 | 771,9 | 51,1 | 10.532,6 | 12.751,4 | 4.475,9 | 773,0 | 754,4 | 930,2 | 116,1 |
| | 2019 | 31.118,0 | 736,2 | 51,1 | 11.346,0 | 10.859,9 | 3.972,0 | 738,1 | 907,6 | 3.242,4 | 0,9 |
| Belgien | 2020 | 877,9 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 877,9 | -- |
| | 2019 | 935,1 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 935,1 | -- | -- |
| Dänemark | 2020 | 8,9 | 8,9 | -- | -- | -- | -- | 8,9 | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Finnland | 2020 | 20,5 | -- | -- | -- | 20,5 | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 20,9 | -- | -- | 20,9 | -- | -- | 0,0 | -- | -- | -- |
| Frankreich | 2020 | 405,6 | 17,0 | -- | 187,8 | 171,0 | 29,8 | 17,0 | -- | -- | -- |
| | 2019 | 477,2 | 15,5 | -- | 421,8 | 8,4 | 31,5 | 15,5 | -- | -- | -- |
| Großbritannien | 2020 | 130,6 | 130,6 | -- | -- | -- | -- | 130,6 | -- | -- | -- |
| | 2019 | 236,6 | 236,6 | -- | -- | -- | -- | 236,6 | -- | -- | -- |
| Luxemburg | 2020 | 2,1 | 2,1 | -- | -- | -- | -- | 2,1 | -- | -- | -- |
| | 2019 | 3,2 | 3,2 | -- | -- | -- | -- | 3,2 | -- | -- | -- |
| Österreich | 2020 | 852,3 | 2,8 | 58,8 | -- | -- | -- | 2,8 | 790,7 | -- | -- |
| | 2019 | 939,0 | 2,7 | 58,8 | -- | -- | -- | 2,7 | 877,5 | -- | -- |
| Portugal | 2020 | 50,0 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 50,0 | -- |
| | 2019 | 175,0 | -- | -- | 50,0 | -- | -- | -- | 125,0 | -- | -- |
| Spanien | 2020 | 77,4 | 0,0 | -- | 20,0 | 33,1 | -- | -- | 24,3 | -- | -- |
| | 2019 | 93,9 | -- | -- | 65,5 | -- | -- | -- | 28,4 | -- | -- |
| Schweiz | 2020 | 46,3 | 0,0 | -- | 46,3 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | 46,1 | -- | -- | 46,1 | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Summe | 2020 | 32.856,3 | 933,3 | 109,9 | 10.786,7 | 12.976,0 | 4.505,7 | 934,4 | 1.569,4 | 1.858,1 | 116,1 |
| | 2019 | 34.045,0 | 994,2 | 109,9 | 11.950,3 | 10.868,3 | 4.003,5 | 996,1 | 2.873,6 | 3.242,4 | 0,9 |



Öffentliche Pfandbriefe - Leistungsrückstände

(§ 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG)

| Öffentliche Pfandbriefe | | Leistungsrückstände > 90 Tage | | | | | Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt | | | | |
|-------------------------|------|-------------------------------|--------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------|---|--------------|---------------------------------|--------------------------------|--------------------|
| Schuldner | | Summe | Davon | | | | Summe | Davon | | | |
| | | | Zentralstaat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige Schuldner | | Zentralstaat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige Schuldner |
| Land | Q3 | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € |
| Deutschland | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Belgien | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Finnland | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Frankreich | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Großbritannien | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Luxemburg | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Österreich | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Portugal | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Spanien | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Schweiz | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| Summe | 2020 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |
| | 2019 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- |



Weitere Deckungswerte

(§ 28 Abs. 1 Nrn. 4, 5 und 6 PfandBG)

| Hypothekendarlehen | | Weitere Deckung | | | | |
|--------------------|-------------|-----------------|---|-----------------------------------|---|--|
| Land | Q3 | Summe Mio. € | Davon | | | |
| | | | Ausgleichs- forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 1 Mio. € | Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2 | | Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 3 Mio. € |
| | | | | Insgesamt Mio. € | Davon Gedekte Schuldver- schreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. € | |
| Gesamtsumme | 2020 | 1.600,8 | -- | -- | -- | 1.600,8 |
| | 2019 | 445,0 | -- | -- | -- | 445,0 |
| Deutschland | 2020 | 1.500,8 | -- | -- | -- | 1.500,8 |
| | 2019 | 345,0 | -- | -- | -- | 345,0 |
| Frankreich | 2020 | 100,0 | -- | -- | -- | 100,0 |
| | 2019 | 100,0 | -- | -- | -- | 100,0 |

| Öffentliche Darlehen | | Weitere Deckung | | | |
|----------------------|-------------|-----------------|---|-----------------------------------|---|
| Land | Q3 | Summe Mio. € | Davon | | |
| | | | Ausgleichs- forderungen i.S.d. § 20 (2) Nr. 1 Mio. € | Forderungen i.S.d. § 20 (2) Nr. 2 | |
| | | | | Insgesamt Mio. € | Davon Gedekte Schuldver- schreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. € |
| Gesamtsumme | 2020 | 137,5 | -- | 137,5 | -- |
| | 2019 | 152,4 | -- | 152,4 | -- |
| Deutschland | 2020 | 137,5 | -- | 137,5 | -- |
| | 2019 | 152,4 | -- | 152,4 | -- |



Hypothekendarfbriefe – Kennzahlen

(§ 28 Abs. 1 Nrn. 7, 8, 9, 10 und 11 sowie Abs. 2 Nr. 3 PfandBG)

10

Hypothekendarfbriefe

| | | Q3 2020 | Q3 2019 |
|--|---------------|-----------------|-----------------|
| Umlaufende Darfbriefe | Mio. € | 12.142,1 | 11.123,5 |
| davon Anteil festverzinslicher Darfbriefe (§ 28 Abs. 1 Nr. 9) | % | 82,3 | 89,4 |
| Deckungsmasse | Mio. € | 17.629,0 | 15.296,1 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Nr. 7) | Mio. € | - | -- |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Nr. 8) | Mio. € | -- | -- |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Nr. 8) | Mio. € | -- | -- |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse (§ 28 Abs. 1 Nr. 9) | % | 61,0 | 58,2 |
| Summe Nettobarwerte | | 6.015,4 | 4.751,8 |
| Nettobarwert nach § 6 Darfbrief-Barwertverordnung je Fremdwahrung in Mio. Euro | EUR | 2.343,8 | 2.274,4 |
| | USD | 2.249,3 | 1.120,2 |
| | GBP | 1.078,8 | 979,5 |
| | CHF | 54,3 | 57,1 |
| | JPY | -- | -- |
| | NOK | 61,2 | 67,3 |
| | SEK | 228,0 | 253,3 |
| § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite) | | | |
| Seasoning - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe) | Jahre | 4,2 | 4,3 |
| § 28 Abs. 1 Nr. 11 | | | |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | % | 59,0 | 58,8 |
| § 28 Abs. 2 Nr. 3 | | | |



Öffentliche Pfandbriefe – Kennzahlen

(§ 28 Abs. 1 Nrn. 8, 9 und 10 PfandBG)

Öffentliche Pfandbriefe

| | | Q3 2020 | Q3 2019 |
|---|---------------|-----------------|-----------------|
| Umlaufende Pfandbriefe | Mio. € | 28.318,7 | 28.172,4 |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe (§ 28 Abs. 1 Nr. 9) | % | 89,2 | 94,1 |
| Deckungsmasse | Mio. € | 32.993,8 | 34.197,4 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Nr. 8) | Mio. € | -- | -- |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse (§ 28 Abs. 1 Nr. 9) | % | 94,5 | 93,1 |
| Summe Nettobarwerte | Mio. € | 6.183,0 | 6.492,4 |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite) | EUR | 6.021,9 | 6.603,2 |
| | USD | 21,4 | -282,2 |
| | GBP | -- | -- |
| | CHF | 137,6 | 169,2 |
| | JPY | 2,1 | 2,2 |
| | NOK | -- | -- |
| | SEK | -- | -- |

