

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
 Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

a) Umlaufende Hypothekendarlehen und dafür verwendete Deckungswerte	Nominal		Barwert		Risikobarwert *	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Hypothekendarlehen	15,366.1	13,351.7	16,662.8	14,701.1	17,654.7	15,640.2
davon:						
<i>Derivate</i>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Deckungsmasse	15,767.3	14,019.2	17,315.1	15,514.9	18,086.7	16,220.0
davon:						
<i>Derivate</i>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Überdeckung	401.1	667.5	652.3	813.8	432.0	579.8
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	401.1	667.5	652.3	813.8	-----	-----

* Für die Berechnung der Stress-Szenarien wird bei Währungen der statische Ansatz, bei Zinsen der dynamische Ansatz verwendet.

zu a) Laufzeitstruktur Restlaufzeit	Hypothekendarlehen		Deckungsmasse	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
bis zu 6 Monate	538.5	279.2	1,903.7	1,015.7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monate	1,193.0	455.0	302.1	564.9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monate	1,372.8	538.0	688.9	666.5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahre	1,454.5	1,193.0	639.0	365.8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahre	2,003.5	2,996.0	1,320.8	1,429.7
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahre	1,935.0	2,123.0	1,881.1	1,493.9
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahre	2,047.0	1,935.0	1,818.8	1,691.6
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahre	4,022.0	2,903.0	6,521.6	6,175.2
über 10 Jahre	799.9	929.5	691.2	615.9

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

b) Umlaufende Öffentliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte	Nominal		Barwert		Risikobarwert *	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Öffentliche Pfandbriefe	262.0	452.1	342.6	552.0	323.0	528.2
<i>davon:</i>						
<i>Derivate</i>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Deckungsmasse	275.5	469.4	427.6	700.7	383.9	635.8
<i>davon:</i>						
<i>Derivate</i>	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Überdeckung	13.5	17.3	85.0	148.7	60.9	107.6
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	13.5	17.3	85.0	148.7	-----	-----

* Für die Berechnung der Stress-Szenarien wird bei Währungen der statische Ansatz, bei Zinsen der dynamische Ansatz verwendet.

zu b) Laufzeitstruktur Restlaufzeit	Öffentliche Pfandbriefe		Deckungsmasse	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
bis zu 6 Monate	0.0	125.1	0.6	13.1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monate	50.0	65.0	2.9	0.5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monate	0.0	0.0	0.4	0.5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahre	10.0	50.0	0.3	2.9
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahre	9.0	10.0	0.6	8.7
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahre	10.0	9.0	0.9	61.1
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahre	20.0	10.0	3.6	0.8
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahre	113.0	133.0	107.1	186.6
über 10 Jahre	50.0	50.0	159.1	195.2

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 4 bis 11 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

§ 28 Abs. 1 Nrn. 4 bis 6 PfandBG: (bzgl. Hypothekendarlehen)	Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen	
--	---	--

§ 28 Abs. 1 Nr. 4 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Ausgleichsforderungen gem. § 19 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	0.0	0.0		
§ 28 Abs. 1 Nr. 5 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Forderungen i.S. des § 19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG		davon: gedeckte Schuldverschreibungen i.S. des Artikels 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Deutschland	1,254.0	432.0	0.0	31.0
Finnland	0.0	10.0	0.0	0.0
Kanada	59.0	117.0	0.0	88.0
Niederlande	0.0	20.0	0.0	20.0
Norwegen	15.0	0.0	0.0	0.0
Schweden	0.0	18.0	0.0	18.0
Summe	1,328.0	597.0	0.0	157.0
§ 28 Abs. 1 Nr. 6 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Forderungen i.S. des § 19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG			
	30.09.2020	30.09.2019		
Deutschland	0.0	6.0		
Summe	0.0	6.0		
§ 28 Abs. 1 Nrn. 4 bis 6 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Gesamtbetrag Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	1,328.0	603.0		

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 4 bis 11 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

§ 28 Abs. 1 Nrn. 4 und 5 PfandBG: (bzgl. Öffentliche Pfandbriefe)	Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe	
---	--	--

§ 28 Abs. 1 Nr. 4 PfandBG (Öffentliche Pfandbriefe)	Ausgleichsforderungen gem. § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	0.0	0.0		

§ 28 Abs. 1 Nr. 5 PfandBG (Öffentliche Pfandbriefe)	Forderungen i.S. des § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG		davon: gedeckte Schuldverschreibungen i.S. des Artikels 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Deutschland	0.0	8.0	0.0	0.0
Dänemark	0.0	2.5	0.0	0.0
Kanada	0.0	16.0	0.0	0.0
Summe	0.0	26.5	0.0	0.0

§ 28 Abs. 1 Nrn. 4 und 5 PfandBG (Öffentliche Pfandbriefe)	Gesamtbetrag Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe	
	30.09.2020	30.09.2019
Summe	0.0	26.5

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 4 bis 11 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

§ 28 Abs. 1 Nrn. 7 bis 11 PfandBG:	Sonstige Angaben zum Deckungsstock und zum Pfandbriefumlauf		
------------------------------------	---	--	--

§ 28 Abs. 1 Nr. 7 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen des § 13 Abs. 1 PfandBG überschreiten			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	0.0	0.0		
§ 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der Prozentwerte nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG liegen			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	0.0	0.0		
§ 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der Prozentwerte nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG liegen			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	0.0	0.0		
§ 28 Abs. 1 Nr. 9 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Prozentualer Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse		Prozentualer Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
in Prozent	73.8	69.1	81.0	88.0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 4 bis 11 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

§ 28 Abs. 1 Nr. 10 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief- Barwertverordnung je Fremdwährung			
	30.09.2020	30.09.2019		
CHF	40.1	39.5		
GBP	103.4	199.4		
§ 28 Abs. 1 Nr. 11 PfandBG (Hypothekendarlehen)	Für die Hypothekendeckung: volumengewichteter Durchschnitt der seit der Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit			
	30.09.2020	30.09.2019		
in Jahren	4.0	4.0		
§ 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG (Öffentliche Pfandbriefe)	Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der Prozentwerte nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG liegen			
	30.09.2020	30.09.2019		
Summe	0.0	0.0		
§ 28 Abs. 1 Nr. 9 PfandBG (Öffentliche Pfandbriefe)	Prozentualer Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse		Prozentualer Anteil der festverzinslichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
in Prozent	100.0	100.0	100.0	100.0
§ 28 Abs. 1 Nr. 10 PfandBG (Öffentliche Pfandbriefe)	Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief- Barwertverordnung je Fremdwährung			
	30.09.2020	30.09.2019		
---	0.0	0.0		

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

§ 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG: Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größenklassen *

* ohne Weitere Deckungswerte gem. § 19 Abs. 1 PfandBG

	Deckungshypotheken	
	30.09.2020	30.09.2019
bis einschl. € 300.000	36.6	46.1
mehr als € 300.000 bis einschl. € 1 Mio.	100.7	118.0
mehr als € 1 Mio. bis einschl. € 10 Mio.	2,435.0	2,488.0
mehr als € 10 Mio.	11,866.9	10,764.1
Summe	14,439.2	13,416.2

§ 28 Abs. 2 Nr. 1 b und c PfandBG: Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen, und nach Nutzungsart *

* ohne Weitere Deckungswerte gem. § 19 Abs. 1 PfandBG

Deckungswerte - gesamt	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		19.3		18.6
Ein- und Zweifamilienhäuser		88.5		90.0
Mehrfamilienhäuser		4,341.1		4,159.2
Bürogebäude	5,463.7		4,833.1	
Handelsgebäude	3,006.1		2,899.7	
Industriegebäude	135.0		123.6	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	1,282.5		1,156.7	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	96.6	0.0	94.0	0.0
Bauplätze	2.2	4.3	34.9	6.4
Summe	9,986.1	4,453.2	9,142.0	4,274.2

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

Berlin Hyp

Belgien	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		0.0		0.0
Ein- und Zweifamilienhäuser		0.0		0.0
Mehrfamilienhäuser		0.0		0.0
Bürogebäude	137.1		204.7	
Handelsgebäude	0.0		0.0	
Industriegebäude	0.0		0.0	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0.0		0.0	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0.0	0.0	0.0	0.0
Bauplätze	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	137.1	0.0	204.7	0.0

Bundesrepublik Deutschland	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		19.1		18.4
Ein- und Zweifamilienhäuser		10.8		12.3
Mehrfamilienhäuser		4,075.3		3,987.7
Bürogebäude	2,611.0		2,154.5	
Handelsgebäude	1,828.4		1,747.0	
Industriegebäude	106.1		94.7	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	955.4		871.9	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	96.6	0.0	94.0	0.0
Bauplätze	2.2	4.3	34.9	6.4
Summe	5,599.7	4,109.5	4,997.0	4,024.8

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

Berlin Hyp

Frankreich	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		0.0		0.0
Ein- und Zweifamilienhäuser		0.0		0.0
Mehrfamilienhäuser		0.0		0.0
Bürogebäude	953.9		806.3	
Handelsgebäude	396.1		271.3	
Industriegebäude	0.0		0.0	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	54.5		54.5	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0.0	0.0	0.0	0.0
Bauplätze	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	1,404.5	0.0	1,132.1	0.0

Großbritannien	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		0.0		0.0
Ein- und Zweifamilienhäuser		0.0		0.0
Mehrfamilienhäuser		0.0		0.0
Bürogebäude	67.9		159.6	
Handelsgebäude	30.9		31.8	
Industriegebäude	0.0		0.0	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0.0		0.0	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0.0	0.0	0.0	0.0
Bauplätze	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	98.8	0.0	191.4	0.0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

Berlin Hyp

Niederlande	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		0.2		0.2
Ein- und Zweifamilienhäuser		77.7		77.7
Mehrfamilienhäuser		265.7		171.5
Bürogebäude	1,024.0		886.8	
Handelsgebäude	396.0		362.0	
Industriegebäude	28.9		28.9	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	205.5		205.6	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0.0	0.0	0.0	0.0
Bauplätze	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	1,654.4	343.7	1,483.3	249.4

Polen	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		0.0		0.0
Ein- und Zweifamilienhäuser		0.0		0.0
Mehrfamilienhäuser		0.0		0.0
Bürogebäude	494.0		445.5	
Handelsgebäude	267.7		400.2	
Industriegebäude	0.0		0.0	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	67.1		24.7	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0.0	0.0	0.0	0.0
Bauplätze	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	828.7	0.0	870.4	0.0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

Tschechische Republik	30.09.2020		30.09.2019	
	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich	Gewerblich	Wohnwirtschaftlich
Eigentumswohnungen		0.0		0.0
Ein- und Zweifamilienhäuser		0.0		0.0
Mehrfamilienhäuser		0.0		0.0
Bürogebäude	175.7		175.7	
Handelsgebäude	87.1		87.4	
Industriegebäude	0.0		0.0	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0.0		0.0	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0.0	0.0	0.0	0.0
Bauplätze	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	262.8	0.0	263.1	0.0

§ 28 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG:	Rückständige Leistungen auf zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen
-----------------------------------	--

	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Bundesrepublik Deutschland	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	0.0	0.0	0.0	0.0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €

Berlin Hyp

§ 28 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG:	Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf
-----------------------------------	---

	Werte in Prozent	
	30.09.2020	30.09.2019
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	56.1	55.6

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €



§ 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG: **Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größenklassen ***

* ohne Weitere Deckungswerte gem. § 20 Abs. 2 PfandBG

	Deckungswerte	
	30.09.2020	30.09.2019
bis einschl. 10 Mio. €	11.1	2.4
mehr als 10 Mio. € bis einschl. 100 Mio. €	264.4	339.4
mehr als 100 Mio. €	0.0	101.1
Summe	275.5	442.9

§ 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG: **Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Staaten und Art der Schuldner bzw. gewährleistenden Stellen ***

* ohne Weitere Deckungswerte gem. § 20 Abs. 2 PfandBG

Deckungswerte - gesamt	30.09.2020		30.09.2019	
	Direktforderungen	Gewährleistungen	Direktforderungen	Gewährleistungen
Zentralstaaten	59.0	0.0	65.0	0.0
Regionale Gebietskörperschaften	201.1	15.1	357.3	20.3
Örtliche Gebietskörperschaften	0.0	0.3	0.0	0.3
Sonstige	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe (Direktforderungen und Gewährleistungen)	275.5		442.9	
hierin: Gewährleist. aus Gründen der Exportförderung		0.0		0.0

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €



Bundesrepublik Deutschland	30.09.2020		30.09.2019	
	Direktforderungen	Gewährleistungen	Direktforderungen	Gewährleistungen
Zentralstaat	0.0	0.0	0.0	0.0
Regionale Gebietskörperschaften	201.1	15.1	357.3	20.3
Örtliche Gebietskörperschaften	0.0	0.3	0.0	0.3
Sonstige	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe (Direktforderungen und Gewährleistungen)	216.5		377.9	
hierin: Gewährleist. aus Gründen der Exportförderung	0.0		0.0	

Österreich	30.09.2020		30.09.2019	
	Direktforderungen	Gewährleistungen	Direktforderungen	Gewährleistungen
Zentralstaat	59.0	0.0	65.0	0.0
Regionale Gebietskörperschaften	0.0	0.0	0.0	0.0
Örtliche Gebietskörperschaften	0.0	0.0	0.0	0.0
Sonstige	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe (Direktforderungen und Gewährleistungen)	59.0		65.0	
hierin: Gewährleist. aus Gründen der Exportförderung	0.0		0.0	

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nrn. 1 bis 3 PfandBG
 Stand: 30.09.2020, Beträge in Mio. €



§ 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG:	Rückständige Leistungen auf zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen
-----------------------------------	---

	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Zentralstaat	0.0	0.0	0.0	0.0
Regionale Gebietskörperschaften	0.0	0.0	0.0	0.0
Örtliche Gebietskörperschaften	0.0	0.0	0.0	0.0
Sonstige	0.0	0.0	0.0	0.0
Summe	0.0	0.0	0.0	0.0