

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG Öffentliche Pfandbriefe

3. Quartal 2021
Stichtag: 30.09.2021

„Deka





Inhaltsverzeichnis

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG

	Seite(n)
I. Gesamtbeträge nach Nennwerten	3
II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	3
III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse	3
IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten	4
V. Laufzeitstruktur	5
VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen	6
VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe	6
VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte	7
IX. Aufteilung der Deckungsmasse - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	8
X. Aufteilung der Deckungsmasse (direkt geschuldet) - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	9
XI. Aufteilung der Deckungsmasse (gewährleistet) - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	10
XII. Aufteilung der Deckungsmasse (Exportkreditförderung) - Ordentliche Deckung in Mio. EUR	11
XIII. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)	12
XIV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)	13

Zusätzliche freiwillige Angaben

I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse	14-15
II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf	16



I. Gesamtbeträge nach Nennwerten

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert	
	Q3/2021	Q3/2020
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.666,4	3.515,8
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.370,4	4.193,1
Überdeckung	704,0	677,3
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	19,2 %	19,3 %

II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Überdeckung	704,0	677,3	763,7	822,7
Überdeckung nach dem vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	704,0	677,3	763,7	822,7
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	19,2 %	19,3 %	19,9 %	21,8 %

III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert	
	Q3/2021	Q3/2020
Derivate	0,0	0,0



IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.666,4	3.515,8	3.829,2	3.782,1
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.370,4	4.193,1	4.592,9	4.604,8
Überdeckung	704,0	677,3	763,7	822,7
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	19,2 %	19,3 %	19,9 %	21,8 %

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Risikobarwert + 250 BP		Risikobarwert - 250 BP		Risikobarwert Währungsstress	
	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.421,4	3.381,0	4.336,3	4.286,5	3.421,4	3.381,0
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.055,2	4.036,3	5.330,0	5.404,3	4.035,9	4.011,4
Überdeckung	633,7	655,3	993,7	1.117,8	614,4	630,5
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	18,5 %	19,4 %	22,9 %	26,1 %	18,0 %	18,6 %

Fremdwährungen	Nettobarwert in Fremdwährung (in Mio.)		Wechselkurs		Nettobarwert in Mio. EUR	
	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
USD	134,1	174,5	1,15790	1,17080	115,8	149,1
Gesamtsumme					115,8	149,1

Hinweis: Die Ermittlung des Risikobarwertes erfolgt nach Maßgabe des statischen Ansatzes gemäß PfandBarwertV



V. Laufzeitstruktur

Laufzeitbänder			Umlauf öffentliche Pfandbriefe in Mio. EUR		Deckungsmasse öffentliche Pfandbriefe in Mio. EUR	
			Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
	<=	6 Monate	393,0	59,5	16,4	325,8
6 Monate	<=	12 Monate	30,0	249,9	70,4	105,3
12 Monate	<=	18 Monate	420,0	643,0	158,3	107,2
18 Monate	<=	2 Jahre	290,0	75,0	131,0	78,7
2 Jahre	<=	3 Jahre	349,9	715,0	556,7	221,0
3 Jahre	<=	4 Jahre	562,0	348,7	275,6	198,9
4 Jahre	<=	5 Jahre	324,0	311,0	327,9	302,2
5 Jahre	<=	10 Jahre	901,9	718,9	1.501,9	1.452,4
	>	10 Jahre	395,6	394,7	1.332,3	1.401,5
Gesamtsumme			3.666,4	3.515,8	4.370,4	4.193,1



VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen

Gesamtnennwert der Deckungsmasse nach Größenklassen (in Mio. EUR)		Q3/2021	Q3/2020
Ordentliche Deckung	<= 10 Mio. EUR	141,9	116,0
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG			
Ordentliche Deckung	10 Mio. EUR <= 100 Mio. EUR	2.173,6	1.747,8
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG			
Ordentliche Deckung	> 100 Mio. EUR	2.055,0	2.329,3
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG			
Summe		4.370,4	4.193,1
Weitere Deckungswerte			
gem. § 20 Absatz 2 PfandBG		0,0	0,0
Gesamtsumme		4.370,4	4.193,1

VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe

Verhältnis der Gesamtsummen zu den Anteilen festverzinslicher Positionen	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Nennwert an festverzinslichen Positionen		davon: Prozentualer Anteil an festverzinslichen Positionen	
	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
	Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.666,4	3.515,8	3.666,4	3.515,8	100,0 %
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.370,4	4.193,1	3.412,6	3.385,4	78,1 %	80,7 %



VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte

Gesamtbetrag der weiteren Deckungswerte gem. § 20 Absatz 2 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2021	Q3/2020
	0,0	0,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 20 Absatz 2 Nr. 1 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2021	Q3/2020
	0,0	0,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 20 Absatz 2 Nr. 2 PfandBG	Code (*)	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013		
		Sitzland der Schuldner	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Gesamtsumme			0,0	0,0	0,0	0,0

Angaben zu § 28 Absatz 1 S. 1 Nr. 8 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2021	Q3/2020
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Absatz 2 PfandBG überschreiten	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**IX. Aufteilung der Deckungsmasse
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen	Land	Code (*)	Staat		Regionale Gebiets- körperschaft		Örtliche Gebiets- körperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme		davon: Gewährleis- tungen aus Export- kreditförderung	
			Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Bundesrepublik Deutschland	DE		114,1	167,2	534,4	466,8	2.449,7	1.926,4	608,5	795,3	3.706,7	3.355,7	114,1	167,2
Dänemark	DK		0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	106,3	70,7	106,3	70,7	106,3	70,7
Frankreich	FR		0,0	2,7	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	2,7	0,0	2,7
Kanada	CA		0,0	0,0	21,2	21,0	0,0	0,0	0,0	0,0	21,2	21,0	0,0	0,0
Lettland	LV		0,0	0,0	0,0	0,0	91,8	108,8	0,0	0,0	91,8	108,8	0,0	0,0
Niederlande	NL		133,3	147,6	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	133,3	147,6	133,3	147,6
Norwegen	NO		37,5	50,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	37,5	50,0	37,5	50,0
Polen	PL		0,0	50,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	50,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US		67,2	117,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	67,2	117,8	67,2	117,8
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB		206,4	268,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	206,4	268,8	206,4	268,8
Summe			558,5	804,1	555,6	487,8	2.541,5	2.035,2	714,8	866,0	4.370,4	4.193,1	664,8	824,8

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**X. Aufteilung der Deckungsmasse (direkt geschuldet)
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der Schuldner		Staat		Regionale Gebiets- körperschaft		Örtliche Gebiets- körperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme	
Land	Code (*)	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	534,4	466,8	2.449,7	1.926,0	608,5	795,3	3.592,6	3.188,2
Kanada	CA	0,0	0,0	12,6	12,4	0,0	0,0	0,0	0,0	12,6	12,4
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	91,8	108,8	0,0	0,0	91,8	108,8
Polen	PL	0,0	50,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	50,0
Summe		0,0	50,0	547,0	479,3	2.541,5	2.034,9	608,5	795,3	3.697,0	3.359,5

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**XI. Aufteilung der Deckungsmasse (gewährleistet)
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der gewährleistenden Stellen	Staat	Regionale Gebiets- körperschaft		Örtliche Gebiets- körperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme			
		Code (*)	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	
Bundesrepublik Deutschland	DE	114,1	167,2	0,0	0,0	0,0	0,3	0,0	0,0	114,1	167,5
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	106,3	70,7	106,3	70,7
Frankreich	FR	0,0	2,7	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	2,7
Kanada	CA	0,0	0,0	8,6	8,5	0,0	0,0	0,0	0,0	8,6	8,5
Niederlande	NL	133,3	147,6	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	133,3	147,6
Norwegen	NO	37,5	50,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	37,5	50,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	67,2	117,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	67,2	117,8
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	206,4	268,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	206,4	268,8
Summe		558,5	754,1	8,6	8,5	0,0	0,3	106,3	70,7	673,5	833,7

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XII. Aufteilung der Deckungsmasse (Exportkreditförderung) Ordentliche Deckung in Mio. EUR

Sitzland der gewährleistenden Stellen	Code (*)	Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Sonstige Schuldner	
		Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Bundesrepublik Deutschland	DE	114,1	167,2	114,1	167,2	0,0	0,0
Dänemark	DK	106,3	70,7	0,0	0,0	106,3	70,7
Frankreich	FR	0,0	2,7	0,0	2,7	0,0	0,0
Niederlande	NL	133,3	147,6	133,3	147,6	0,0	0,0
Norwegen	NO	37,5	50,0	37,5	50,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	67,2	117,8	67,2	117,8	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	206,4	268,8	206,4	268,8	0,0	0,0
Summe		664,8	824,8	558,5	754,1	106,3	70,7

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XIII. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)

Sitzland der Schuldner bzw. der Gewährleistenden Stellen		Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Regionale Gebietskörperschaft		davon: Örtliche Gebietskörperschaft		davon: Sonstige Schuldner	
Land	Code (*)	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Frankreich	FR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kanada	CA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Niederlande	NL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Norwegen	NO	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Polen	PL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe		0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XIV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen		Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Regionale Gebietskörperschaft		davon: Örtliche Gebietskörperschaft		davon: Sonstige Schuldner	
Land	Code (*)	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020	Q3/2021	Q3/2020
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Frankreich	FR	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kanada	CA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Niederlande	NL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Norwegen	NO	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Polen	PL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe		0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

		Q3/2021
WAL der Deckungsmasse (Total)	in Jahren	6,2
Volumen notenbankfähiger Wertpapiere	in Mio. EUR	420,0
Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien)	in %	2,0

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q3/2021
EUR		4.262,9
USD		107,6

Aktuelles Pfandbriefrating (gemäß Ratingagentur)	Q3/2021
Moody's	Aaa



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

Aufteilung der Forderungen gegenüber Zentralbanken und Kreditinstituten i.S.d. § 28 Absatz 1 Nr. 5 nach Bonitätsstufe	in Mio. EUR	Q3/2021
Bonitätsstufe 1		0,0
Bonitätsstufe 2		0,0

Kredite (*)		Q3/2021
Anzahl der Kredite		267
Anzahl der Kreditnehmer		92
Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer	in Mio. EUR	1.508,7
Volumen an Anleihen	in Mio. EUR	441,2
Volumen an Krediten	in Mio. EUR	3.929,2

Derivate		Q3/2021
Sind Derivate in Deckung?	Ja / Nein	Nein
Nettobarwert der Derivate in Deckung	in Mio. EUR	0,0
Typ der Swap-Kontrahenten (I=Intern, E=Extern, B=Beide, N=None)	(I, E, B, N)	N

(*) Hinweis: Die Berechnungen beziehen sich nur auf Titel der ordentlichen Deckung.



II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf

		Q3/2021
WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)	in Jahren	4,9
Besteht die Möglichkeit einer Fälligkeitsverschiebung?	Ja / Nein	Ja
Maximal mögliche Verschiebung?	in Monaten	12,0
Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt?	Ja / Nein	Ja
Sind Pass through Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Nicht anwendbar (**)

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q3/2021
EUR		3.666,4

(**) Hinweis: Nicht anwendbar nach derzeitiger Rechtslage.