

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG Öffentliche Pfandbriefe

2. Quartal 2022
Stichtag: 30.06.2022

„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	
	Q2/2022	Q2/2021
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.504,1	3.441,9
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.418,5	4.157,7
Überdeckung	914,4	715,7
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	26,1 %	20,8 %

II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Überdeckung	914,4	715,7	859,9	776,0
Überdeckung nach dem vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	914,4	715,7	859,9	776,0
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	26,1 %	20,8 %	25,7 %	21,4 %

III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert	
	Q2/2022	Q2/2021
Derivate	0,0	0,0



IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.504,1	3.441,9	3.345,0	3.620,6
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.418,5	4.157,7	4.204,9	4.396,6
Überdeckung	914,4	715,7	859,9	776,0
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	26,1 %	20,8 %	25,7 %	21,4 %

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Risikobarwert + 250 BP		Risikobarwert - 250 BP		Risikobarwert Währungsstress	
	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.019,9	3.234,7	3.741,1	4.105,9	3.019,9	3.234,7
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	3.765,7	3.884,9	4.789,1	5.101,7	3.746,3	3.864,5
Überdeckung	745,8	650,2	1.048,0	995,7	726,5	629,8
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	24,7 %	20,1 %	28,0 %	24,3 %	24,1 %	19,5 %

Fremdwährungen	Nettobarwert in Fremdwährung (in Mio.)		Wechselkurs		Nettobarwert in Mio. EUR	
	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
USD	120,4	145,7	1,03870	1,18840	115,9	122,6
Gesamtsumme					115,9	122,6

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	
			Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
	<=	6 Monate	170,0	0,5	4,0	78,1
6 Monate	<=	12 Monate	525,0	673,0	285,2	79,0
12 Monate	<=	18 Monate	15,0	170,0	204,0	12,0
18 Monate	<=	2 Jahre	351,2	550,0	342,9	250,2
2 Jahre	<=	3 Jahre	293,0	364,9	235,5	494,8
3 Jahre	<=	4 Jahre	347,8	42,0	172,9	293,4
4 Jahre	<=	5 Jahre	510,0	344,0	493,3	199,2
5 Jahre	<=	10 Jahre	895,5	901,9	1.227,8	1.431,5
	>	10 Jahre	396,6	395,6	1.453,0	1.319,6
Gesamtsumme			3.504,1	3.441,9	4.418,5	4.157,7



VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen

Gesamtnennwert der Deckungsmasse nach Größenklassen (in Mio. EUR)		Q2/2022	Q2/2021
Ordentliche Deckung	<= 10 Mio. EUR	155,0	133,3
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG			
Ordentliche Deckung	10 Mio. EUR <= 100 Mio. EUR	2.587,2	2.038,5
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG			
Ordentliche Deckung	> 100 Mio. EUR	1.676,3	1.985,8
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG			
Summe		4.418,5	4.157,7
Weitere Deckungswerte		0,0	0,0
gem. § 20 Absatz 2 PfandBG			
Gesamtsumme		4.418,5	4.157,7

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	
	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.504,1	3.441,9	3.504,1	3.441,9	100,0 %	100,0 %
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.418,5	4.157,7	3.545,8	3.198,9	80,2 %	76,9 %



VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte

Gesamtbetrag der weiteren Deckungswerte gem. § 20 Absatz 2 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q2/2022	Q2/2021
	0,0	0,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 20 Absatz 2 Nr. 1 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q2/2022	Q2/2021
	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	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Gesamtsumme			0,0	0,0	0,0	0,0

Angaben zu § 28 Absatz 1 S. 1 Nr. 8 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q2/2022	Q2/2021
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

Land	Code (*)	Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme		davon: Gewährleistungen aus Exportkreditförderung	
		Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	50,5	119,7	498,2	535,4	2.507,1	2.299,4	745,5	546,2	3.801,3	3.500,7	50,5	119,7
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	111,0	66,2	111,0	66,2	111,0	66,2
Kanada	CA	0,0	0,0	23,7	20,7	0,0	0,0	0,0	0,0	23,7	20,7	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	78,5	96,1	0,0	0,0	78,5	96,1	0,0	0,0
Niederlande	NL	122,2	139,9	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	122,2	139,9	122,2	139,9
Norwegen	NO	31,3	43,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	31,3	43,8	31,3	43,8
Vereinigte Staaten von Amerika	US	58,7	72,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	58,7	72,8	58,7	72,8
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	192,0	217,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	192,0	217,4	192,0	217,4
Summe		454,6	593,6	521,9	556,1	2.585,6	2.395,5	856,4	612,4	4.418,5	4.157,7	565,6	659,9

(*) 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 (*)	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	498,2	535,4	2.507,1	2.299,3	745,5	546,2	3.750,8	3.380,9
Kanada	CA	0,0	0,0	14,0	12,3	0,0	0,0	0,0	0,0	14,0	12,3
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	78,5	96,1	0,0	0,0	78,5	96,1
Summe		0,0	0,0	512,3	547,7	2.585,6	2.395,5	745,5	546,2	3.843,3	3.489,3

(*) 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 Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme	
Land	Code (*)	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	50,5	119,7	0,0	0,0	0,0	0,1	0,0	0,0	50,5	119,7
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	111,0	66,2	111,0	66,2
Kanada	CA	0,0	0,0	9,6	8,4	0,0	0,0	0,0	0,0	9,6	8,4
Niederlande	NL	122,2	139,9	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	122,2	139,9
Norwegen	NO	31,3	43,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	31,3	43,8
Vereinigte Staaten von Amerika	US	58,7	72,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	58,7	72,8
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	192,0	217,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	192,0	217,4
Summe		454,6	593,6	9,6	8,4	0,0	0,1	111,0	66,2	575,2	668,3

(*) 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	
		Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	50,5	119,7	50,5	119,7	0,0	0,0
Dänemark	DK	111,0	66,2	0,0	0,0	111,0	66,2
Niederlande	NL	122,2	139,9	122,2	139,9	0,0	0,0
Norwegen	NO	31,3	43,8	31,3	43,8	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	58,7	72,8	58,7	72,8	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	192,0	217,4	192,0	217,4	0,0	0,0
Summe		565,6	659,9	454,6	593,6	111,0	66,2

(*) 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 (*)	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
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
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
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 (*)	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021	Q2/2022	Q2/2021
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
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
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

		Q2/2022
WAL der Deckungsmasse (Total)	in Jahren	6,0
Volumen notenbankfähiger Wertpapiere	in Mio. EUR	350,0
Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien)	in %	2,0

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q2/2022
EUR		4.308,2
USD		110,3

Aktuelles Pfandbriefrating (gemäß Ratingagentur)	Q2/2022
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	Q2/2022
Bonitätsstufe 1		0,0
Bonitätsstufe 2		0,0

Kredite (*)		Q2/2022
Anzahl der Kredite		289
Anzahl der Kreditnehmer		96
Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer	in Mio. EUR	1.564,2
Volumen an Anleihen	in Mio. EUR	373,7
Volumen an Krediten	in Mio. EUR	4.044,8

Derivate		Q2/2022
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

		Q2/2022
WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)	in Jahren	4,7
Sind Soft Bullet Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Ja
Wenn ja: Ausmaß der Fälligkeitsverschiebung?	in Monaten	12
Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt?	Ja / Nein	Ja
Sind Pass through Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Nicht anwendbar (**)

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q2/2022
EUR		3.504,1

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