

# Sparkasse Dortmund

## Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Hypothekendarlehenpfandbriefumlauf

Stichtag	30.06.2021
Referenz	30.06.2020

### I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	15,00	+	15,12	+	11,87	+
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	286,86	+	325,92	+	272,12	+
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	+	0,00%	+	0,00%	+
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	+	0,00%	+	0,00%	+
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	+	0,00%	+	0,00%	+
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	+	0,00%	+	0,00%	+
Überdeckung in %	1812,39%	-	2056,22%	-	2191,72%	-

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
bis zu sechs Monate	0,00	+	2,91	+
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,00	+	3,13	+
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	+	6,31	+
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,00	+	2,68	+
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	+	11,42	+
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,00	+	12,45	+
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	+	18,04	+
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	15,00	+	141,38	+
über 10 Jahre	0,00	+	88,54	+

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	30.06.2021	30.06.2020
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	100,00%	+
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	+

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
	0,00	+	0,00	+	0,00	+	0,00	+	0,00	+

\* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

## II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	30.06.2021	30.06.2020
------------------------------	------------	------------

nach Größenklassen		
bis zu 300 Tsd. €	174,80	÷
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	36,29	÷
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	73,07	÷
mehr als 10 Mio. €	0,00	÷

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)		
wohnwirtschaftlich	235,17	÷
gewerblich	48,99	÷

### nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)

Staat	Stichtag	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zweifamilien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertrags- fähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	30.06.2021	35,38	120,25	79,54	8,55	16,23	1,97	22,24	0,00	0,00	<b>284,16</b>
	30.06.2020	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	<b>0,00</b>
<b>Summe</b>	<b>30.06.2021</b>	<b>35,38</b>	<b>120,25</b>	<b>79,54</b>	<b>8,55</b>	<b>16,23</b>	<b>1,97</b>	<b>22,24</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>284,16</b>
	<b>30.06.2020</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Weitere Kennzahlen		30.06.2021	30.06.2020
--------------------	--	------------	------------

§28 (1) Nr. 7 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 (1) PfandBG überschreiten.	in Mio. EUR	0,00	÷
§28 (1) Nr. 11 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning).	in Jahren	3,11	÷
§28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf.	in %	56,90%	÷

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	284,16	÷
Anteil am Gesamtumlauf	in %	1894,39%	÷

### III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG		
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	30.06.21	30.06.20
§19 (1) Nr. 2 PfandBG	0,00	÷
§19 (1) Nr. 3 PfandBG	0,00	÷

§ 28 (1) Nr. 4, 5 und 6 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 2 PfandBG				Forderungen i.S.d. §19 (1) Nr. 3 PfandBG		Summe	
			Gesamt		davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013		30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20				
Staat										
Bundesrepublik Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,70	0,00	2,70	0,00
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2,70</b>	<b>0,00</b>	<b>2,70</b>	<b>0,00</b>

### IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG		Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
Staat		30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
keine		0,00	÷	0,00	÷
<b>Summe</b>		<b>0,00</b>	<b>÷</b>	<b>0,00</b>	<b>÷</b>

## V) Anhang des Jahresabschlusses

§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsversteigerungsverfahren	-	÷	-	÷
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsverwaltungsverfahren	-	÷	-	÷
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsverwaltungs- verfahren mit gleichzeitigen Zwangsversteigerungsverfahren	-	÷	-	÷
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	-	÷	-	÷
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten übernommenen Grundstücke	-	÷	-	÷
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen (Angaben in Mio. Euro)	-	÷	-	÷