

Stadtsparkasse München

Report zum Hypothekendarlehenpfandbriefumlauf

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	III 2018
Referenz	III 2017

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	710,00	560,00	710,59	562,47	594,92	469,61	852,02	597,10
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.674,44	1.429,37	1.805,88	1.563,73	1.585,98	1.377,58	2.074,16	1.611,25
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.644,44	1.304,37	1.775,63	1.436,38	1.558,19	1.257,21	2.041,03	1.483,92
davon weitere Deckungswerte	30,00	125,00	30,25	127,35	27,78	120,37	33,12	127,33
Überdeckung in %	135,84%	155,24%	154,14%	178,01%	166,59%	193,35%	143,44%	169,85%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			4,26%					

II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2018		Laufzeitstruktur III 2017		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2018	III 2017
bis zu sechs Monate	82,97	-	72,96	100,00	82,97	- 27,04
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	32,01	-	42,24	-	32,01	42,24
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	73,88	-	47,30	-	73,88	47,30
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	78,09	-	33,05	-	78,09	33,05
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	150,79	-	136,36	-	150,79	136,36
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	190,54	-	155,84	-	190,54	155,84
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	132,39	-	159,09	-	132,39	159,09
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	788,08	710,00	640,56	460,00	78,08	180,56
über 10 Jahre	145,69	-	141,97	-	145,69	141,97

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse) (Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Weitere Deckung gem. §28 Abs. 1 Nr. 4 - 6 PfandBG	Forderungen i.S.d. §19 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG mit Ausnahme der Werte i.S.d. §4 Abs. 1 S. 2 Nr. 1 und 2		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		Forderungen i.S.d. §19 Abs.1 Nr. 3 PfandBG zzgl. §19 Abs. 1 Nr. 2 i.V.m. §4 Abs. 1 S. 2 Nr. 1 und 2	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	105,00	-	105,00	30,00	125,00
Summe	-	-	-	105,00	-	105,00	30,00	125,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
keine	-	-	-	-	-	-

	III 2018	III 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	96,67%	93,47%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	54,42%	54,57%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist(§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des §19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des §19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG überschreiten	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	4,43	4,74

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	III 2018	III 2017	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse
--	----------	----------	--

nach Größenklassen			
bis einschließlich 300 T€	408,51	334,80	
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	448,90	331,82	
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	623,05	540,69	
mehr als 10 Mio.€	163,98	97,07	

nach Nutzungsart (I) in Deutschland			
wohnwirtschaftlich	1.203,13	925,07	
gewerblich	441,31	379,30	

nach Nutzungsart (II) in Deutschland			
Eigentumswohnungen	365,23	244,54	21,81%
Ein- und Zweifamilienhäuser	473,84	380,04	28,30%
Mehrfamilienhäuser	364,05	300,49	21,74%
Bürogebäude	149,77	96,32	8,94%
Handelsgebäude	39,79	29,00	2,38%
Industriegebäude	68,14	96,47	4,07%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	183,61	157,52	10,97%
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	-	-	0,00%
Bauplätze	-	-	0,00%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 2 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	
	III 2018	III 2017	III 2018	III 2017
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-