

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 1, 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

3. Quartal 2022

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	13.259,0	11.167,2	12.875,4	11.438,1	12.186,3	10.804,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	16.923,9	16.223,1	16.177,8	17.525,0	14.385,9	15.449,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	3.664,9	5.055,9	3.302,3	6.086,8	2.199,6	4.645,1
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27,6	45,3	25,6	53,2	18,0	43,0
Gesetzliche Überdeckung **/****	(Mio. €)	553,7	-	511,4	-	469,7	-
Vertragliche Überdeckung **/****	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung **/****	(Mio. €)	3.111,2	-	2.790,9	-	1.729,9	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	3.664,9	5.055,9	3.302,3	6.086,8		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27,6	45,3	25,6	53,2		

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	10.576,6	10.055,8	10.459,9	10.892,4	9.760,5	10.007,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.460,8	12.014,1	12.511,8	13.898,0	11.281,8	12.217,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	1.884,1	1.958,4	2.051,8	3.005,7	1.521,3	2.210,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,8	19,5	19,6	27,6	15,6	22,1
Gesetzliche Überdeckung **/****	(Mio. €)	436,0	-	422,0	-	387,2	-
Vertragliche Überdeckung **/****	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung **/****	(Mio. €)	1.448,1	-	1.629,8	-	1.134,1	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	1.884,1	1.958,4	2.051,8	3.005,7		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,8	19,5	19,6	27,6		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der statische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 PfandBarwertV verwendet.

** Das gesetzliche Überdeckungserfordernis setzt sich aus der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG inkl. Zins- und Währungsstressszenarien und der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG zusammen.

*** Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen

3. Quartal 2022

Hypothekendarlehen	Q3 2022		Q3 2021	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	725,2	1.286,9	1.455,8	1.837,3
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.028,0	965,6	795,7	872,2
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.147,8	939,7	712,2	760,7
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	614,5	1.027,0	1.028,0	742,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	2.800,5	2.878,4	1.562,1	1.739,2
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.298,2	1.970,7	2.030,4	2.580,2
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	894,6	1.399,5	1.097,6	1.599,2
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	4.162,8	5.021,8	2.178,4	4.804,7
> 10 Jahre	587,4	1.434,3	306,9	1.287,1

Q3 2022 FäV (12 Monate)*	Q3 2021** FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
725,2	-
1.028,0	-
1.762,3	-
2.800,5	-
1.298,2	-
4.238,0	-
1.406,8	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2022		Q3 2021	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	710,6	647,7	700,2	659,1
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	713,3	832,7	833,9	1.026,3
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	636,1	602,3	709,8	502,3
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	752,6	667,8	714,6	600,7
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.340,6	1.075,3	686,1	1.010,4
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.068,4	1.258,6	1.340,6	814,5
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.507,5	1.512,9	916,9	1.058,4
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.597,3	3.431,7	3.094,0	3.895,5
> 10 Jahre	1.250,2	2.431,8	1.059,6	2.446,9

Q3 2022 FäV (12 Monate)*	Q3 2021** FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
710,6	-
713,3	-
1.388,7	-
1.340,6	-
1.068,4	-
3.887,0	-
1.468,0	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q3 2022	Q3 2021**
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	<p>Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsunfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsunfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.</p>	
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	<p>Der Sachwalter kann die Fälligkeiten der Tilgungszahlungen verschieben, wenn die maßgeblichen Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG hierfür erfüllt sind. Die Verschiebungsdauer, welche einen Zeitraum von 12 Monaten nicht überschreiten darf, bestimmt der Sachwalter entsprechend der Erforderlichkeit.</p> <p>Der Sachwalter kann die Fälligkeiten von Tilgungs- und Zinszahlungen, die innerhalb eines Monats nach seiner Ernennung fällig werden, auf das Ende dieses Monatszeitraums verschieben. Entschieden sich der Sachwalter für eine solche Verschiebung, wird das Vorliegen der Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG unwiderlegbar vermutet. Eine solche Verschiebung ist im Rahmen der Höchstverschiebungsdauer von 12 Monaten zu berücksichtigen.</p> <p>Der Sachwalter darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe einer Emission nur einheitlich Gebrauch machen. Hierbei dürfen die Fälligkeiten vollständig oder anteilig verschoben werden. Der Sachwalter hat die Fälligkeit für eine Pfandbriefemission so zu verschieben, dass die ursprüngliche Reihenfolge der Bedienung der Pfandbriefe, welche durch die Verschiebung überholt werden könnten, nicht geändert wird (Überholverbot). Dies kann dazu führen, dass auch die Fälligkeiten später fällig werdender Emissionen zu verschieben sind, um das Überholverbot zu wahren. Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2a und 2b PfandBG.</p>	

* Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

** Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

3. Quartal 2022

Deckungswerte	Q3 2022 Mio. €	Q3 2021 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	2.630,0	2.777,5
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	1.087,1	893,0
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.791,1	2.679,0
Mehr als 10 Mio. €	9.577,0	8.846,9
Summe	16.085,2	15.196,4

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

3. Quartal 2022

Deckungswerte	Q3 2022 Mio. €	Q3 2021 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	3.000,0	2.956,3
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	3.185,9	3.330,9
Mehr als 100 Mio. €	6.275,0	5.726,9
Summe	12.460,8	12.014,1

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

3. Quartal 2022

		Deckungswerte														Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	3. Quartal	Mio. €	Wohnwirtschaftlich						Gewerblich								
			Insgesamt	davon					Insgesamt	davon							
				Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	16.085,2	6.836,4	1.048,6	1.817,1	3.957,3	0,4	12,9	9.248,8	5.247,8	2.042,6	1.027,6	872,8	49,6	8,3	-	-
	Jahr 2021	15.196,4	6.484,1	1.043,7	1.710,3	3.717,6	0,5	12,0	8.712,3	4.225,7	1.896,8	933,7	1.635,1	8,3	12,7	-	-
Deutschland	Jahr 2022	13.106,0	6.621,3	1.048,6	1.817,1	3.742,2	0,4	12,9	6.484,7	3.097,7	1.605,8	1.012,1	711,3	49,6	8,3	-	-
	Jahr 2021	12.281,7	6.303,1	1.043,7	1.710,3	3.536,6	0,5	12,0	5.978,7	2.395,6	1.601,8	933,7	1.026,5	8,3	12,7	-	-
Belgien	Jahr 2022	19,8	-	-	-	-	-	-	19,8	19,8	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	19,8	-	-	-	-	-	-	19,8	19,8	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	197,8	-	-	-	-	-	-	197,8	189,6	-	8,2	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	124,0	-	-	-	-	-	-	124,0	124,0	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	853,9	-	-	-	-	-	-	853,9	755,9	6,5	-	91,6	-	-	-	-
	Jahr 2021	1.015,8	-	-	-	-	-	-	1.015,8	729,2	21,3	-	265,3	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	315,4	-	-	-	-	-	-	315,4	231,8	6,3	7,3	70,0	-	-	-	-
	Jahr 2021	301,2	-	-	-	-	-	-	301,2	224,9	-	-	76,3	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2022	181,7	-	-	-	-	-	-	181,7	118,1	63,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	156,8	-	-	-	-	-	-	156,8	99,0	57,8	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2022	1.410,6	215,1	-	-	215,1	-	-	1.195,5	835,0	360,5	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	1.297,1	181,1	-	-	181,1	-	-	1.116,0	633,1	216,0	-	267,0	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

3. Quartal 2022

Deckungswerte											
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige*	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	12.460,8	2.738,6	60,8	2.219,2	4.733,8	1.564,1	2.755,1	180,0	914,3	33,5
	Jahr 2021	12.014,1	1.606,5	120,9	2.431,9	4.729,4	1.758,1	1.656,7	167,2	1.149,9	-
Deutschland	Jahr 2022	11.659,9	2.120,2	-	2.147,5	4.733,8	1.564,1	2.120,2	180,0	914,3	-
	Jahr 2021	11.406,8	1.249,1	-	2.352,9	4.729,4	1.758,1	1.249,3	167,2	1.149,9	-
Belgien	Jahr 2022	34,4	34,4	-	-	-	-	34,4	-	-	-
	Jahr 2021	28,8	28,8	-	-	-	-	28,8	-	-	-
Dänemark	Jahr 2022	146,3	146,3	-	-	-	-	146,3	-	-	-
	Jahr 2021	90,8	90,8	-	-	-	-	90,8	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	72,0	72,0	-	-	-	-	72,0	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	2,9	2,9	-	-	-	-	2,9	-	-	-
Kroatien	Jahr 2022	20,0	-	20,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	36,9	36,9	-	-	-	-	36,9	-	-	-
	Jahr 2021	29,7	29,7	-	-	-	-	29,7	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	72,1	33,7	12,8	25,6	-	-	33,7	-	-	-
	Jahr 2021	110,5	48,5	32,8	29,2	-	-	48,5	-	-	-
Polen	Jahr 2022	18,0	-	18,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	68,1	-	68,1	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2022	87,0	87,0	-	-	-	-	87,0	-	-	-
	Jahr 2021	85,7	85,7	-	-	-	-	85,7	-	-	-
Slowenien	Jahr 2022	10,0	-	10,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	20,0	-	20,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	40,0	-	-	40,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	40,0	-	-	40,0	-	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	174,5	174,5	-	-	-	-	174,5	-	-	-
	Jahr 2021	71,0	71,0	-	-	-	-	71,0	-	-	-
USA	Jahr 2022	39,7	33,5	-	6,1	-	-	-	-	-	33,5
	Jahr 2021	9,8	-	-	9,8	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	50,0	-	-	-	-	-	50,0	-	-	-
	Jahr 2021	50,0	-	-	-	-	-	50,0	-	-	-

* Die Position beinhaltet Förderbanken in Höhe von 728 Mio. EUR für 2022 und in Höhe von 728 Mio. EUR für 2021.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
3. Quartal 2022**

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Dänemark	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kroatien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 8, 9, 10 PfandBG

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarfbriefe 3. Quartal 2022

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarfbriefe nach § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b), § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c), § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4*							
Staat	3. Quartal	Summe	davon				
			Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b)		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4
			Insgesamt	davon	Insgesamt	davon	
			gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	838,7	20,0	20,0	146,0	96,0	672,7
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	416,2	-	-	50,0	-	366,2
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2022	32,0	-	-	-	-	32,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Kroatien	Jahr 2022	44,9	-	-	-	-	44,9
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	134,6	20,0	20,0	-	-	114,6
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2022	45,0	-	-	-	-	45,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2022	96,0	-	-	96,0	96,0	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Slowenien	Jahr 2022	33,0	-	-	-	-	33,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	37,0	-	-	-	-	37,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 8, 9 PfandBG

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe 3. Quartal 2022

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2, § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis c), § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4*							
Staat	3. Quartal	Summe	davon				
			Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4
			Insgesamt	davon	Insgesamt	davon	
			gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-

* Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 6, 7, 11, 12, 13, 14, 15 PfandBG und § 28 Abs. 2 S. 1 Nrn. 3, 4 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten 3. Quartal 2022

Hypothekendarlehen		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	13.259,0	11.167,2
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	65,5	74,5
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	16.923,9	16.223,1
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 12 Abs. 1, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 S. 2, 2. Halbsatz überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenzen nach § 19 Abs. 1 S. 7 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	80,6	79,5
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro			
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	159,1	148,4
	CHF	24,2	29,0
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	779,9	1.019,1
	HKD	-	-
	JPY	0,5	0,5
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	747,5	693,6
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,6	5,8
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	55,5	55,0
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe - (Durchschnitt)	%	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	449,7	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	49	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	769,2	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Buchstabe d (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Buchstabe d (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt	%	-	-

* Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht

Öffentliche Pfandbriefe		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	10.576,6	10.055,8
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	61,8	68,2
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.460,8	12.014,1
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 3 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12		-	
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	74,0	79,7
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	6,8	1,0
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	204,5	150,1
AUD	-	-	
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	501,7	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	27	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	1.385,7	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt	%	-	-

* Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN)
nach Pfandbriefgattung
3. Quartal 2022

Hypothekendarlehenpfandbriefe		
	Q3 2022	Q3 2021*
ISIN	DE000LBW6CA9, DE000LBW6CB7, DE000LBW6CC5, DE000LBW6CD3, DE000LBW6CE1, DE000LBW6CF8, DE000LBW6CG6, DE000LBW6CH4, DE000LBW6CJ0, DE000LBW6CK8, DE000LBW6CL6, DE000LBW6CM4, DE000LBW6CN2, DE000LBW6CP7, DE000LBW6CQ5, DE000LBW6CR3, DE000LBW6CS1, DE000LBW6CT9, DE000LBW6CU7, DE000LBW6CV5, DE000LBW6CW3, DE000LBW6CZ6, DE000LBW6C96, DE000LB0QZS8, DE000LB0Q803, DE000LB0R082, DE000LB0SYX7, DE000LB0SZ17, DE000LB0UXH8, DE000LB0UXK2, DE000LB0UX31, DE000LB0VEN4, DE000LB0V7F3, DE000LB0VPR1, DE000LB0VPZ4, DE000LB0VQ05, DE000LB0VQ39, DE000LB0VQ54, DE000LB0V9T5, DE000LB0WA44, DE000LB0WA51, DE000LB0WA77, DE000LB0WW30, DE000LB0XYZ2, DE000LB0ZZX9, DE000LB0Z0P8, DE000LB0Z0X2, DE000LB0Z085, DE000LB00CF5, DE000LB00CM1, DE000LB00C93, DE000LB00DG1, DE000LB00MU3, DE000LB01RP0, DE000LB01WS4, DE000LB06C06, DE000LB06FA6, DE000LB09PQ5, DE000LB1A706, DE000LB1B0U5, DE000LB1B0V3, DE000LB1B2S5, DE000LB1DRM4, DE000LB1DRN2, DE000LB1DRT9, DE000LB1DSM2, DE000LB1DSZ4, DE000LB1DVW5, DE000LB1DVX3, DE000LB1M2X2, DE000LB1P2E9, DE000LB1P6B6, DE000LB1P8N7, DE000LB1P8P2, DE000LB1P9C8, DE000LB124H8, DE000LB125N3, DE000LB126Q6, DE000LB2CHJ1, DE000LB2CJQ2, DE000LB2CJR0, DE000LB2CJS8, DE000LB2CPG0, DE000LB2CQG8, DE000LB2CR05, DE000LB2CR21, DE000LB2CS87, DE000LB2CTZ2, DE000LB2CYI5, DE000LB2CYZ2, DE000LB2CY06, DE000LB2CY14, DE000LB2CY22, DE000LB2CY30, DE000LB2CY48, DE000LB2CY55, DE000LB2CY97, DE000LB2CZA2, DE000LB2CZB0, DE000LB2CZC8, DE000LB2CZD6, DE000LB2CZE4, DE000LB2C0B3, DE000LB2V502, DE000LB2V6L6, DE000LB2V6M4, DE000LB2WAB1, DE000LB2WAF2, DE000LB2ZSM3, DE000LB2ZS07, DE000LB2ZTL3, DE000LB2ZTR0, DE000LB2ZT55, DE000LB2ZT63, DE000LB2ZUX6, DE000LB2ZUY4, DE000LB2ZVN5, DE000LB2ZV93, DE000LB2ZWR4, DE000LB2ZWS2, DE000LB2ZWT0, DE000LB2ZX91, DE0002050572, DE0002050598, DE0002050622, DE0002050630, DE0002050648, DE0002050655, DE0002050663, DE0002050671, DE0002050705, DE0002050721, DE0002060167, DE0002060175, DE0002060209, DE0002060217, DE0002060233, DE0002060241, DE0002820693, DE0003440350, DE0003440368, DE0003440392, DE0003440426, DE0003450417, DE0003450433, DE0003450474, DE0003450490, DE0003450532, DE0003450581, DE0003450615, DE0003450623, DE0003450631, DE0003450649, DE0003450656, DE0003450664, DE0003450672, DE0003450714, XF0002050478, XF0002820128, XF0002820201, XF0002820367, XF0003440157, XF0003440165, XF0003440199, XF0003440306, XF0003440462, XF0003450248, XF0003450263, XF0003450271, XF0003450693, XF0003450701	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q3 2022	Q3 2021*
ISIN	DE000LBW0HZ8, DE000LBW3Q77, DE000LBW6PJ2, DE000LBW7JJ3, DE000LBW7YY1, DE000LB0BF02, DE000LB0R058, DE000LB00C85, DE000LB00DA4, DE000LB009J7, DE000LB01R04, DE000LB01WY2, DE000LB01WZ9, DE000LB06CF2, DE000LB1B1G2, DE000LB1B1S7, DE000LB1DQ71, DE000LB1DR96, DE000LB1D0B3, DE000LB1D064, DE000LB1D1B1, DE000LB1M0Z, DE000LB1P2X9, DE000LB126S0, DE000LB13AH8, DE000LB13A41, DE000LB2CKN7, DE000LB2CLB0, DE000LB2CMY0, DE000LB2CRR3, DE000LB2CRU7, DE000LB2CRZ6, DE000LB2CSN0, DE000LB2CSV3, DE000LB2CTH0, DE000LB2CYL2, DE000LB2CYN8, DE000LB2CYP3, DE000LB2CYQ1, DE000LB2CYR9, DE000LB2CYS7, DE000LB2CYT5, DE000LB2CYU3, DE000LB2CYV1, DE000LB2WAG0, DE000LB2WAH8, DE000LB2WAK2, DE000LB2WAL0, DE000LB2WAM8, DE000LB2WAN6, DE000LB2ZSL5, DE000LB2ZS31, DE000LB2ZVB0, DE000LB2ZVC8, DE000LB2ZVE4, DE000LB2ZXF7, DE000LB38077, DE0002823911, DE0003413266, DE0003413308, DE0003443032, DE0003453106, DE0003453148, DE0003453197	-

* Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

Zahldifferenzen können rundungsbedingt auftreten.