

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. €)	33.515,3	33.130,7	30.158,5	34.677,6	25.793,7	32.883,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	39.387,8	38.526,1	37.259,6	43.091,2	31.076,2	40.518,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	5.872,5	5.395,4	7.101,1	8.413,6	5.282,5	7.635,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,5	16,3	23,5	24,3	20,5	23,2
Gesetzliche Überdeckung***	(Mio. €)	1.354,4	-	1.238,3	-	1.045,9	-
Vertragliche Überdeckung***	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung***	(Mio. €)	4.518,1	-	5.862,8	-	4.236,7	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	5.872,5	5.395,3	7.101,1	8.413,6		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,5	16,3	23,5	24,3		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	9.910,1	12.684,1	10.132,1	15.358,9	7.810,8	14.343,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.467,8	14.293,3	12.545,3	17.781,9	9.816,0	16.383,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.557,7	1.609,2	2.413,2	2.423,0	2.005,2	2.040,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,8	12,7	23,8	15,8	25,7	14,2
Gesetzliche Überdeckung***	(Mio. €)	399,9	-	402,1	-	312,6	-
Vertragliche Überdeckung***	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung***	(Mio. €)	2.157,9	-	2.011,1	-	1.692,5	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	2.557,8	1.609,2	2.413,1	2.423,0		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,8	12,7	23,8	15,8		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 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

Hypothekenzinspfandbriefe	Q3 2022		Q3 2021	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	963,0	2.087,9	1.778,5	1.742,6
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	839,0	1.749,4	1.992,0	1.555,4
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	2.050,5	1.672,3	1.165,0	1.723,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	1.581,9	1.769,9	961,5	1.758,4
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	2.917,5	3.508,2	4.033,4	3.391,0
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	4.160,5	3.891,2	3.112,1	3.287,5
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	4.296,0	4.144,5	4.538,0	4.010,1
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	11.810,0	13.005,0	12.791,1	13.732,0
> 10 Jahre	4.896,9	7.559,4	2.759,2	7.325,9

Q3 2022 FäV (12 Monate)*	Q3 2021** FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
963,0	-
839,0	-
3.632,4	-
2.917,5	-
4.160,5	-
15.250,0	-
5.752,9	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2022		Q3 2021	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	432,5	530,7	1.926,6	681,3
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	357,6	718,8	778,2	634,7
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	427,8	609,3	442,5	480,5
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	490,3	603,5	331,4	674,9
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.142,9	986,9	928,1	1.137,7
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.044,1	1.014,0	1.112,6	1.047,3
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	553,5	899,7	1.091,8	964,9
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.827,8	2.989,5	2.160,8	3.545,1
> 10 Jahre	3.633,6	4.115,5	3.912,2	5.127,0

Q3 2022 FäV (12 Monate)*	Q3 2021** FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
432,5	-
357,6	-
918,1	-
1.142,9	-
1.044,1	-
2.098,3	-
3.916,6	-

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. Entscheidet 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 Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um eine 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. €	9.478,3	8.861,6
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	2.799,9	2.536,0
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	10.471,2	10.793,9
Mehr als 10 Mio. €	15.690,4	15.458,6
Summe	38.439,8	37.650,1

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen
3. Quartal 2022

Deckungswerte	Q3 2022 Mio. €	Q3 2021 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	5.728,5	5.885,1
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	4.300,2	4.940,0
Mehr als 100 Mio. €	2.439,1	3.468,3
Summe	12.467,8	14.293,4

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 rückständ- igen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt	
		Insgesamt	davon															
			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				
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten		Jahr 2022	38.440,0	21.915,8	2.109,3	7.097,3	12.412,2	270,0	27,0	16.524,2	7.295,3	4.626,0	226,5	4.176,1	192,4	7,9	-	-
		Jahr 2021	37.650,1	21.564,8	1.795,4	6.544,6	12.981,5	229,6	13,7	16.085,3	6.803,7	4.818,6	206,4	4.062,6	184,2	9,8	-	-
Deutschland		Jahr 2022	37.031,9	21.907,2	2.109,2	7.096,9	12.404,1	270,0	27,0	15.124,7	6.417,8	4.278,2	226,5	4.009,6	184,7	7,9	-	-
		Jahr 2021	36.320,1	21.564,2	1.795,4	6.544,0	12.981,5	229,6	13,7	14.755,9	5.954,6	4.432,2	206,4	3.968,7	184,2	9,8	-	-
Belgien		Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich		Jahr 2022	299,1	8,3	-	0,3	8,0	-	-	290,8	174,7	116,1	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2021	305,1	0,3	-	0,3	-	-	-	304,8	155,2	149,6	-	-	-	-	-	-
Großbritannien		Jahr 2022	270,0	-	-	-	-	-	-	270,0	253,1	9,2	-	-	7,7	-	-	-
		Jahr 2021	262,2	-	-	-	-	-	-	262,2	252,7	9,5	-	-	-	-	-	-
Niederlande		Jahr 2022	724,7	0,1	-	0,1	-	-	-	724,6	445,4	123,4	-	155,8	-	-	-	-
		Jahr 2021	653,3	0,2	-	0,2	-	-	-	653,1	436,9	123,4	-	92,8	-	-	-	-
Österreich		Jahr 2022	14,0	-	-	-	-	-	-	14,0	4,3	-	-	9,7	-	-	-	-
		Jahr 2021	4,3	-	-	-	-	-	-	4,3	4,3	-	-	-	-	-	-	-
Polen		Jahr 2022	47,8	-	-	-	-	-	-	47,8	-	47,8	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2021	49,0	-	-	-	-	-	-	49,0	-	49,0	-	-	-	-	-	-
Schweden		Jahr 2022	52,3	-	-	-	-	-	-	52,3	-	51,3	-	1,0	-	-	-	-
		Jahr 2021	56,1	-	-	-	-	-	-	56,1	-	55,0	-	1,1	-	-	-	-

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	12.467,9	-	597,1	2.244,1	8.524,3	566,6	91,1	340,1	100,8	3,8
	Jahr 2021	14.293,3	-	1.198,2	2.861,6	9.109,4	625,9	51,1	314,6	128,3	4,2
Deutschland	Jahr 2022	10.801,9	-	26,0	1.428,4	8.484,9	495,2	91,1	171,7	100,8	3,8
	Jahr 2021	11.663,7	-	203,8	1.586,6	8.993,7	538,4	51,1	157,6	128,3	4,2
Belgien	Jahr 2022	68,0	-	45,0	23,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	53,0	-	30,0	23,0	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	40,0	-	40,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	44,8	-	40,0	-	4,8	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2022	115,0	-	10,0	98,8	6,2	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	356,2	-	170,0	108,8	77,4	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2022	7,4	-	7,4	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	7,4	-	7,4	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	443,7	-	418,7	25,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	441,9	-	416,9	25,0	-	-	-	-	-	-
Portugal	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	280,0	-	280,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	328,5	-	50,0	224,3	30,0	-	-	24,2	-	-
	Jahr 2021	803,3	-	50,0	699,1	30,0	-	-	24,2	-	-
Schweiz	Jahr 2022	156,9	-	-	156,9	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	170,8	-	-	170,8	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2022	435,1	-	-	287,7	3,2	-	-	144,2	-	-
	Jahr 2021	384,6	-	-	248,3	3,5	-	-	132,8	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	71,4	-	-	-	-	71,4	-	-	-	-
	Jahr 2021	87,5	-	-	-	-	87,5	-	-	-	-

**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 Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Summe	davon 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
3. Quartal 2022

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen 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	948,0	-	-	-	-
		Jahr 2021	-	-	-	-	-
Deutschland		Jahr 2022	948,0	-	-	-	-
		Jahr 2021	-	-	-	-	-

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

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	Mio. €	davon		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4	
			Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2					
			Insgesamt	davon	Insgesamt	davon	Insgesamt	davon
				gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		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.

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

Hypothekendarlehen		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	33.515,3	33.130,7
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	99,5	98,7
Deckungsmasse	(Mio. €)	39.387,8	38.526,1
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* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	89,8	89,4
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	213,8	270,3
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	43,5	55,6
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,1	5,0
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	54,2	54,2
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. €)	56,0	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	23,0	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	788,8	-
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.	%	-	-

Öffentliche Pfandbriefe

		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	9.910,1	12.684,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	93,3	95,3
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.467,8	14.293,3
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	%	97,9	97,7
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	28,2	33,6
	CHF	52,9	83,1
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	19,8	29,3
	HKD	-	-
	JPY	29,2	32,3
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	10,3	89,6
	AUD	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*			
Größe sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	115,4	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	176,0	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	1.257,4	-

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.	%	-	-

Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-
---	---	---	---

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	DE000A0SMD13, DE000A1REYU0, DE000A1REY26, DE000A1REY59, DE000A1REZE1, DE000A1REZQ5, DE000A1TNEQ7, DE000A1TNEX3, DE000A1X3M51, DE000A1X3M93, DE000A12T2F9, DE000A12T6Z8, DE000A12UGG2, DE000A13SR38, DE000A13SWR8, DE000A13SWZ1, DE000A14J5J4, DE000A14KKH9, DE000A14KKK3, DE000A14KKM9, DE000A14KK24, DE000A161ZL4, DE000A161ZQ3, DE000A161ZU5, DE000A2AASB4, DE000A2AAW12, DE000A2AAW53, DE000A2AAX03, DE000A2AAX11, DE000A2AAX45, DE000A2AAX60, DE000A2BPJ45, DE000A2BPJ78, DE000A2BPJ86, DE000A2E4UX0, DE000A2GSMH3, DE000A2GSMJ9, DE000A2GSMK7, DE000A2GSP31, DE000A2GSP49, DE000A2GSP56, DE000A2GSP64, DE000A2GSP80, DE000A2GSP98, DE000A2G9HA2, DE000A2G9HB0, DE000A2G9HC8, DE000A2G9HD6, DE000A2G9HE4, DE000A2G9HF1, DE000A2G9HG9, DE000A2G9HJ3, DE000A2G9HK1, DE000A2G9HL9, DE000A2G9HM7, DE000A2G9HN5, DE000A2G9HQ8, DE000A2NB841, DE000A2TSDV6, DE000A2TSDW4, DE000A2TSDY0, DE000A2TSD06, DE000A2TSD55, DE000A288367, DE000A289PA7, DE000A289PB5, DE000A289PC3, DE000A289PD1, DE000A289PE9, DE000A289PG4, DE000A289PH2, DE000A3E5UT4, DE000A3E5UU2, DE000A3E5UY4, DE000A3E5U22, DE000A3H2TK9, DE000A3H2TQ6, DE000A3H2TR4, DE000A3MP601, DE000A3MP619, DE000A3MP627, DE000A3MP635, DE000A3MP643, DE000A3MP650, DE000A3MP668, DE000A3MP684, DE000A3MP692, DE000A3MQUV7, DE000A3MQUW5, DE000A3MQUX3	-
Öffentliche Pfandbriefe		
	Q3 2022	Q3 2021*
ISIN	DE000A0DLV76, DE000A0EUMF2, DE000A0EUMR7, DE000A0EUM34, DE000A0EUM42, DE000A0EUPJ7, DE000A0XFAE1, DE000A1TM6A4, DE000A1YC8G2, DE000A1YC8K4, DE000A12TYS2, DE000A14J5C9, DE000A161ZP5, DE000A2BPJ11, DE000A2BPJ29, DE000A2BPJ52, DE000A2BPJ60, DE000A2GSMB6, DE000A2GSMC4, DE000A2GSP23, DE000A2TSDZ7	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-

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