

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

**Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte**
**4. Quartal 2023**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4 2023	Q4 2022	Q4 2023	Q4 2022	Q4 2023	Q4 2022
<b>Hypothekendarfandbriefe</b>	(Mio. €)	847,5	1.142,5	828,2	1.097,5	793,2	1.043,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	6.853,2	6.465,9	6.582,1	5.957,4	5.821,2	5.277,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	6.005,7	5.323,4	5.753,9	4.859,9	5.027,9	4.233,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		708,6	465,9	694,7	442,8	633,8	405,5
Gesetzliche Überdeckung <sup>1</sup>	(Mio. €)	34,4	44,9	16,6	43,0		
Vertragliche Überdeckung <sup>2</sup>	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung <sup>3</sup>	(Mio. €)	5.971,3	5.278,4	5.737,3	4.816,9		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	6.005,7	5.323,4	5.753,9	4.859,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		708,6	465,9	694,7	442,8		

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

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4 2023	Q4 2022	Q4 2023	Q4 2022	Q4 2023	Q4 2022
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	168,4	178,4	165,3	172,4	154,7	159,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	297,8	292,7	299,5	285,0	273,1	255,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	129,4	114,3	134,3	112,6	118,3	95,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		76,8	64,1	81,2	65,3	76,5	60,3
Gesetzliche Überdeckung <sup>1</sup>	(Mio. €)	7,0	7,7	3,3	7,0		
Vertragliche Überdeckung <sup>2</sup>	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung <sup>3</sup>	(Mio. €)	122,4	106,6	131,0	105,7		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	129,4	114,3	134,3	112,6		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		76,8	64,1	81,2	65,3		

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

<sup>1</sup> Nach dem

Nominalwert: Summe aus der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG und des Nennwerts der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG

Barwert: Barwertige sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG; Die Vorjahreskenzzahl (Q3/2022) 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.

<sup>2</sup> Vertraglich zugesicherte Überdeckung

<sup>3</sup> Residual, in Abhängigkeit der gesetzlichen und vertraglichen Überdeckung; Barwert enthält den Barwert der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG

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

**Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen**  
**4. Quartal 2023**

Hypothekendarlehen	Q4 2023		Q4 2022		Q4 2023	Q4 2022
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Fäv (12 Monate)*	Fäv (12 Monate)*
Restlaufzeit:	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Pfandbriefumlauf	Pfandbriefumlauf
					Mio. €	Mio. €
<= 0,5 Jahre	273,0	298,7	280,0	398,0	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	52,5	302,6	20,0	288,0	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	280,0	244,7	273,0	251,6	273,0	280,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	318,9	52,5	284,8	52,5	20,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	10,0	671,4	275,0	465,7	280,0	325,5
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	82,0	644,6	10,0	577,1	10,0	275,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	31,5	691,9	82,0	665,4	82,0	10,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	118,5	2.818,8	150,0	2.718,7	150,0	230,5
> 10 Jahre	-	861,6	-	816,5	-	1,5

Öffentliche Pfandbriefe	Q4 2023		Q4 2022		Q4 2023	Q4 2022
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Fäv (12 Monate)*	Fäv (12 Monate)*
Restlaufzeit:	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Pfandbriefumlauf	Pfandbriefumlauf
					Mio. €	Mio. €
<= 0,5 Jahre	65,0	6,8	10,0	8,0	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	7,2	-	12,6	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	50,0	62,5	65,0	6,5	65,0	10,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	10,5	-	7,0	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	30,2	50,0	47,8	-	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	32,6	-	30,0	50,0	65,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	70,0	-	32,4	-	50,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	53,4	71,3	20,0	116,5	20,0	20,0
> 10 Jahre	-	6,8	33,4	31,9	33,4	33,4

**Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe**

	Q4 2023	Q4 2022
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), 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.	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), 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.
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	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.  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.  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.	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.  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.  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.

\* 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.

**Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen**

**4. Quartal 2023**

Deckungswerte	Q4 2023 Mio. €	Q4 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	4.200,2	4.077,0
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	1.498,1	1.335,7
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	808,8	729,8
Mehr als 10 Mio. €	45,6	21,3
<b>Summe</b>	<b>6.552,6</b>	<b>6.163,8</b>

**Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen**

**4. Quartal 2023**

Deckungswerte	Q4 2023 Mio. €	Q4 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	93,1	109,7
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	204,8	183,0
Mehr als 100 Mio. €	-	-
<b>Summe</b>	<b>297,8</b>	<b>292,7</b>

**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.**

**4. Quartal 2023**

Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt		
Staat	4. Quartal	Insgesamt		davon						Insgesamt								Mio. €	Mio. €
		Mio. €	Mio. €	Wohnwirtschaftlich						Gewerblich									
				Insgesamt		davon		Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze	Insgesamt	davon		Handels- gebäude	Industrie- gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude				
Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €				Mio. €	Mio. €							
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	6.552,6	5.755,3	1.102,0	2.993,4	1.659,9	-	-	797,3	428,1	175,8	74,0	119,4	-	-	-	-		
	Jahr 2022	6.163,8	5.409,3	1.036,9	2.828,7	1.543,7	-	-	754,5	403,9	162,7	58,7	129,3	-	-	-	-		
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	6.552,6	5.755,3	1.102,0	2.993,4	1.659,9	-	-	797,3	428,1	175,8	74,0	119,4	-	-	-	-		
	Jahr 2022	6.163,8	5.409,3	1.036,9	2.828,7	1.543,7	-	-	754,5	403,9	162,7	58,7	129,3	-	-	-	-		

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen**

**4. Quartal 2023**

<b>Deckungswerte</b>											
		<b>Summe</b>		<b>davon geschuldet von</b>				<b>davon gewährleistet von</b>			
		<b>in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung</b>		<b>Zentralstaat</b>	<b>Regionale Gebietskörperschaften</b>	<b>Örtliche Gebietskörperschaften</b>	<b>Sonstige</b>	<b>Zentralstaat</b>	<b>Regionale Gebietskörperschaften</b>	<b>Örtliche Gebietskörperschaften</b>	<b>Sonstige</b>
Staat	<b>4. Quartal</b>	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	297,8	-	76,0	-	144,3	69,0	-	-	8,6	-
	Jahr 2022	292,7	-	51,0	-	158,8	68,9	-	-	13,9	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	266,8	-	45,0	-	144,3	69,0	-	-	8,6	-
	Jahr 2022	261,7	-	20,0	-	158,8	68,9	-	-	13,9	-
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2023	31,0	-	31,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	31,0	-	31,0	-	-	-	-	-	-	-

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen  
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt  
4. Quartal 2023**

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
Staat	4. Quartal	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarstellungen**  
**4. Quartal 2023**

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarstellungen 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	4. Quartal	Mio. €	davon		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4
			Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b)		Insgesamt	davon	
			Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>							
	Jahr 2023	300,6	-	-	-	-	300,6
	Jahr 2022	302,1	-	-	-	-	302,1
<b>Deutschland</b>							
	Jahr 2023	150,0	-	-	-	-	150,0
	Jahr 2022	96,5	-	-	-	-	96,5
<b>Luxemburg</b>							
	Jahr 2023	65,6	-	-	-	-	65,6
	Jahr 2022	65,6	-	-	-	-	65,6
<b>Niederlande</b>							
	Jahr 2023	85,0	-	-	-	-	85,0
	Jahr 2022	85,0	-	-	-	-	85,0
<b>Schweden</b>							
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	55,0	-	-	-	-	55,0

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe**  
**4. Quartal 2023**

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	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 gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>4. Quartal</b>							
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>							
Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-
Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>							
Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-
Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-



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**  
**4. Quartal 2023**

Hypothekendarlehen		Q4 2023	Q4 2022
<b>Hypothekendarlehen</b>			
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	847,5	1.142,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
<b>Deckungsmasse</b>			
Deckungsmasse	(Mio. €)	6.853,2	6.465,9
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	%	100,0	100,0
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,3	5,2
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	53,5	53,3
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe - (Durchschnitt)	%	-	-
<b>Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG</b>			
Größe sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	234,7	161,8
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	41	147
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	280,7	272,7
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG</b>			
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)	%	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG</b>			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

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

### 4. Quartal 2023

Öffentliche Pfandbriefe		Q4 2023	Q4 2022
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	168,4	178,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
<b>Deckungsmasse</b>			
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	297,8	292,7
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	%	100,0	100,0
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
<b>Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG</b>			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	15,6	10,9
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	57	81
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	72,9	45,9
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG</b>			
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)	%	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG</b>			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung  
4. Quartal 2023

Hypothekendarlehen		
	Q4 2023	Q4 2022
ISIN	DE000A1TM490, DE000A14J538, DE000A254RH2, DE000A254RJ8, DE000A254RK6, DE000A30VUY6	DE000A1R01C6, DE000A1TM3M6, DE000A1TM490, DE000A14J5X5, DE000A14J538, DE000A254RH2, DE000A254RJ8, DE000A254RK6