DekaBank Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstraße 16
60325 Frankfurt am Main
Telefon: +49 69 7147 - 652
Telefax: +49 69 7147 - 1376
E-Mail: service@deka.de
Internet: www.deka.de

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
1. Quartal 2023

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022
Hypothekenpfandbriefe	(Mio. €)	691,0	460,0	651,9	449,9	617,4	418,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.283,8	1.136,5	1.237,5	1.153,9	1.164,0	1.075,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	592,8	676,5	585,6	703,9	546,6	657,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		85,8	147,1	89,8	156,5	88,5	157,1
Gesetzliche Überdeckung**, [1]	(Mio. €)	27,6	-	27,1	-		
Vertragliche Überdeckung**, [2]	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung**, [3]	(Mio. €)	565,2	-	558,5	-		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	592,8	676,5	585,6	703,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		85,8	147,1	89,8	156,5		

* 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*	
		Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.414,1	3.509,1	3.159,9	3.491,9	2.833,5	3.124,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.332,7	4.534,8	3.966,2	4.530,1	3.549,9	4.017,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	918,6	1.025,8	806,3	1.038,1	716,4	893,7
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		26,9	29,2	25,5	29,7	25,3	28,6
Gesetzliche Überdeckung**, [1]	(Mio. €)	139,3	-	133,2	-		
Vertragliche Überdeckung**, [2]	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung**, [3]	(Mio. €)	779,3	-	673,1	-		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	918,6	1.025,8	806,3	1.038,1		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		26,9	29,2	25,5	29,7		

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

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

[1] 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

[2] Vertraglich zugesicherte Überdeckung

[3] 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.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 4, 5 PfandBG

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
1. Quartal 2023

Hypothekenpfandbriefe	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023 FäV (12 Monate)*	Q1 2022** FäV (12 Monate)*
Restlaufzeit:	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €
<= 0,5 Jahre	40,0	98,0	15,0	64,8	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	20,0	64,7	25,0	71,5	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	99,2	40,0	16,2	40,0	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	130,0	164,2	20,0	-	20,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	390,0	241,7	130,0	336,8	130,0	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	56,0	153,9	130,0	241,7	390,0	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	55,0	224,1	50,0	156,4	56,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	238,0	50,0	249,1	55,0	-
> 10 Jahre	-	-	-	-	-	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023 FäV (12 Monate)*	Q1 2022** FäV (12 Monate)*
Restlaufzeit:	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €
<= 0,5 Jahre	135,0	151,6	5,0	66,2	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	265,0	347,6	570,0	199,3	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	133,5	189,5	140,0	124,5	135,0	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	274,1	128,8	265,0	355,0	265,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	370,7	163,2	359,2	409,1	407,6	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	501,0	269,8	366,8	217,5	370,7	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	260,0	493,6	501,0	319,3	501,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.177,2	1.161,9	905,5	1.402,6	1.087,2	-
> 10 Jahre	297,6	1.426,7	396,6	1.441,3	647,6	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Q1 2023	Q1 2022**
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	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.	
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.	

* 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.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG, § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG und § 28 Abs. 4 Nr. 1 a PfandBG

Zur Deckung von Hypothekenpfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
1. Quartal 2023

Deckungswerte	Q1 2023 Mio. €	Q1 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	-	-
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	-	-
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	-	-
Mehr als 10 Mio. €	1.199,6	1.111,5
Summe	1.199,6	1.111,5

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
1. Quartal 2023

Deckungswerte	Q1 2023 Mio. €	Q1 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	153,6	157,5
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.529,3	2.378,1
Mehr als 100 Mio. €	1.620,5	1.999,3
Summe	4.303,4	4.534,8

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 b, c und Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Hypothekenpfandbriefen 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.

1. Quartal 2023

		Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
		Insgesamt	davon														
			Wohnwirtschaftlich						Gewerblich								
			Insgesamt	davon					Insgesamt	davon							
				Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		
Staat	**1. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	1.199,6	-	-	-	-	-	-	1.199,6	978,0	63,0	-	158,6	-	-	-	-
	Jahr 2022	1.111,5	-	-	-	-	-	-	1.111,5	898,2	63,0	-	150,4	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2023	548,8	-	-	-	-	-	-	548,8	327,2	63,0	-	158,6	-	-	-	-
	Jahr 2022	541,9	-	-	-	-	-	-	541,9	328,6	63,0	-	150,4	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2023	650,7	-	-	-	-	-	-	650,7	650,7	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	569,6	-	-	-	-	-	-	569,6	569,6	-	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

1. Quartal 2023

		Deckungswerte									
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper-schaften	Örtliche Gebietskörper-schaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper-schaften	Örtliche Gebietskörper-schaften	Sonstige
Staat	**1. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	4.303,4	491,9	-	466,5	2.573,0	757,3	394,3	14,7	-	97,6
	Jahr 2022	4.534,8	616,5	-	582,4	2.560,4	766,5	517,7	9,0	-	98,7
Deutschland	Jahr 2023	3.798,2	79,4	-	453,1	2.508,4	757,3	79,4	-	-	-
	Jahr 2022	3.924,0	110,7	-	569,3	2.477,5	766,5	110,7	-	-	-
Dänemark	Jahr 2023	97,6	97,6	-	-	-	-	-	-	-	97,6
	Jahr 2022	98,7	98,7	-	-	-	-	-	-	-	98,7
Großbritannien	Jahr 2023	154,9	154,9	-	-	-	-	154,9	-	-	-
	Jahr 2022	191,3	191,3	-	-	-	-	191,3	-	-	-
Lettland	Jahr 2023	64,7	-	-	-	64,7	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	83,0	-	-	-	83,0	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2023	91,1	91,1	-	-	-	-	91,1	-	-	-
	Jahr 2022	122,9	122,9	-	-	-	-	122,9	-	-	-
Norwegen	Jahr 2023	18,8	18,8	-	-	-	-	18,8	-	-	-
	Jahr 2022	31,3	31,3	-	-	-	-	31,3	-	-	-
Kanada	Jahr 2023	28,1	-	-	13,4	-	-	-	14,7	-	-
	Jahr 2022	22,1	-	-	13,1	-	-	-	9,0	-	-
USA	Jahr 2023	50,1	50,1	-	-	-	-	50,1	-	-	-
	Jahr 2022	61,5	61,5	-	-	-	-	61,5	-	-	-

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekenpfandbriefe

1. Quartal 2023

		Weitere Deckungswerte für Hypothekenpfandbriefe 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*					
		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 **gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013**	**Insgesamt**	davon **gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013**	
Staat	**1. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	84,3	-	-	84,3	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2023	84,3	-	-	84,3	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-

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

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe

1. 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*						
		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 Schuld-verschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013**	**Insgesamt**	davon **gedeckte Schuld-verschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013**	**Insgesamt**	davon **gedeckte Schuld-verschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013**
Staat	**1. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	29,3	-	-	-	-	29,3	-
	Jahr 2022	-		-		-	-	-
Deutschland	Jahr 2023	29,3	-	-	-	-	29,3	-
	Jahr 2022	-		-		-	-	-

* 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
1. Quartal 2023

Hypothekenpfandbriefe			
		Q1 2023	**Q1 2022**
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	691,0	460,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.283,8	1.136,5
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	%	71,0	74,7
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	3,3	3,2
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	59,8	59,5
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. €)	-36,0	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	77	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	79,7	-
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.

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
1. Quartal 2023

Öffentliche Pfandbriefe			
		Q1 2023	**Q1 2022**
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	3.414,1	3.509,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.332,7	4.534,8
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	%	80,8	79,7
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	50,8	109,4
	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. €)	-34,2	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	74	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	355,2	-
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.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 PfandBG

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

Hypothekenpfandbriefe

	Q1 2023	Q1 2022*
ISIN	DE000DK010T3, DE000DK0JTW7, DE000DK0JTX5, DE000DK0JTY3, DE000DK0JTZ0, DE000DK0T061, DE000DK0T095, DE000DK0T7L8, DE000DK0YUH5, DE000DK0YUR4, DE000DK0YUS2, XS2517101478	-

Öffentliche Pfandbriefe

	Q1 2023	Q1 2022*
ISIN	DE000DK0JTV9, XS1875412980, XS1952579495, XS2021499871, XS2051657463, XS2109453691, XS2332799431, XS2366703259, XS2449929194, XS2502402360, XS2529513850, XS2537088598, XS2579303780	-

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