



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
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	931,0	691,0	918,5	646,9	875,7	609,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.429,9	1.194,3	1.414,8	1.142,7	1.327,4	1.078,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	498,9	503,3	496,3	495,8	451,7	469,3
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		53,6	72,8	54,0	76,6	51,6	77,1
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	36,8	26,7	18,4	12,9		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	462,1	476,5	477,9	482,8		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	498,9	503,3	496,3	495,8		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		53,6	72,8	54,0	76,6		

* 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
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.178,4	3.807,4	3.012,2	3.499,4	2.737,0	3.162,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.040,9	4.571,9	3.795,8	4.166,9	3.394,7	3.751,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	862,5	764,5	783,6	667,4	657,7	588,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27,1	20,1	26,0	19,1	24,0	18,6
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	125,3	149,1	60,2	70,0		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	737,1	615,5	723,3	597,5		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	862,5	764,5	783,6	667,4		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27,1	20,1	26,0	19,1		

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

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.

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

Hypothekendarlehen	Q4 2023		Q4 2022	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	68,2	40,0	54,3
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	80,0	214,5	20,0	113,8
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	50,0	-	-	67,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	440,0	241,7	80,0	227,7
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	306,0	153,9	440,0	241,7
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	55,0	352,2	56,0	153,9
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	249,6	55,0	93,1
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	149,7	-	242,6
> 10 Jahre	-	-	-	-

Q4 2023 FäV (12 Monate)*	Q4 2022 FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
-	40,0
80,0	20,0
490,0	80,0
306,0	440,0
55,0	56,0
-	55,0
-	55,0
-	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q4 2023		Q4 2022	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	352,5	350,4	520,0	313,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	69,3	102,5	15,0	200,1
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	270,0	182,9	351,2	359,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	270,0	105,6	319,9	95,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	331,7	199,3	290,0	234,7
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	510,0	450,1	327,8	224,8
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	291,0	510,8	510,0	518,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	810,7	835,0	1.177,0	1.186,3
> 10 Jahre	273,1	1.304,4	296,6	1.440,4

Q4 2023 FäV (12 Monate)*	Q4 2022 FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
352,5	520,0
270,0	95,0
69,3	15,0
510,0	671,1
331,7	290,0
510,0	327,8
1.077,2	1.337,0
297,6	646,6

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. 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. 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. 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. 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.

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 Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

4. Quartal 2023

Deckungswerte	Q4 2023 Mio. €	Q4 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	-	-
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	-	-
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	35,4	-
Mehr als 10 Mio. €	1.169,8	1.095,0
Summe	1.205,2	1.095,0

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

4. Quartal 2023

Deckungswerte	Q4 2023 Mio. €	Q4 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	154,5	140,3
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.103,2	2.641,1
Mehr als 100 Mio. €	1.672,2	1.761,3
Summe	3.929,9	4.542,7

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		Wohnwirtschaftlich						Gewerblich								
		Mio. €	Mio. €	Insgesamt					Mio. €	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. €			
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	1.205,2	-	-	-	-	-	-	1.205,2	899,6	63,0	-	242,6	-	-	-		
	Jahr 2022	1.095,0	-	-	-	-	-	-	1.095,0	892,0	63,0	-	140,0	-	-	-		
Deutschland	Jahr 2023	623,2	-	-	-	-	-	-	623,2	327,2	63,0	-	232,9	-	-	-		
	Jahr 2022	494,5	-	-	-	-	-	-	494,5	291,5	63,0	-	140,0	-	-	-		
Frankreich	Jahr 2023	582,0	-	-	-	-	-	-	582,0	572,3	-	-	9,7	-	-	-		
	Jahr 2022	600,6	-	-	-	-	-	-	600,6	600,6	-	-	-	-	-	-		

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

4. Quartal 2023

Deckungswerte											
Staat	4. Quartal	Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		Mio. €	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörperschaften Mio. €	Örtliche Gebietskörperschaften Mio. €	Sonstige Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörperschaften Mio. €	Örtliche Gebietskörperschaften Mio. €	Sonstige Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	3.929,9	442,7	-	288,9	2.433,2	750,6	320,6	14,5	-	122,2
	Jahr 2022	4.542,7	539,3	-	511,1	2.684,9	792,4	432,8	15,0	-	106,5
Deutschland	Jahr 2023	3.464,5	55,3	-	275,8	2.382,8	750,6	55,3	-	-	-
	Jahr 2022	3.989,5	84,1	-	497,4	2.615,6	792,4	84,1	-	-	-
Dänemark	Jahr 2023	122,2	122,2	-	-	-	-	-	-	-	122,2
	Jahr 2022	106,5	106,5	-	-	-	-	-	-	-	106,5
Großbritannien	Jahr 2023	129,9	129,9	-	-	-	-	129,9	-	-	-
	Jahr 2022	170,5	170,5	-	-	-	-	170,5	-	-	-
Lettland	Jahr 2023	50,3	-	-	-	50,3	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	69,3	-	-	-	69,3	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2023	81,4	81,4	-	-	-	-	81,4	-	-	-
	Jahr 2022	100,3	100,3	-	-	-	-	100,3	-	-	-
Norwegen	Jahr 2023	12,5	12,5	-	-	-	-	12,5	-	-	-
	Jahr 2022	25,0	25,0	-	-	-	-	25,0	-	-	-
Kanada	Jahr 2023	27,7	-	-	13,2	-	-	-	14,5	-	-
	Jahr 2022	28,7	-	-	13,7	-	-	-	15,0	-	-
USA	Jahr 2023	41,4	41,4	-	-	-	-	41,4	-	-	-
	Jahr 2022	53,0	53,0	-	-	-	-	53,0	-	-	-

**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 Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
	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		davon		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4
			Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b)		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		
			Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	224,7	52,7	52,7	122,0	121,0	50,0
	Jahr 2022	99,3	-	-	99,3	-	-
Deutschland	Jahr 2023	83,7	32,7	32,7	1,0	-	50,0
	Jahr 2022	99,3	-	-	99,3	-	-
Belgien	Jahr 2023	50,0	-	-	50,0	50,0	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Finnland	Jahr 2023	18,0	-	-	18,0	18,0	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2023	48,0	20,0	20,0	28,0	28,0	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Norwegen	Jahr 2023	25,0	-	-	25,0	25,0	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-

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 b), § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4								
Staat	4. Quartal	Summe	davon					
			Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis b)		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. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	111,0	110,0	110,0	-	1,0	-	
	Jahr 2022	29,3	-	-	-	29,3	-	
Deutschland	Jahr 2023	111,0	110,0	110,0	-	1,0	-	
	Jahr 2022	29,3	-	-	-	29,3	-	

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
Hypothekendarlehen			
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	931,0	691,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.429,9	1.194,3
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	%	83,2	66,7
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	4,0	3,3
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	59,8	59,8
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe - (Durchschnitt)	%	-	-
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. €)	-	-7,0
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	-	167
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	210,6	72,2
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.	%	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

4. Quartal 2023

Öffentliche Pfandbriefe		Q4 2023	Q4 2022
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	3.178,4	3.807,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.040,9	4.571,9
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	%	84,8	80,8
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	45,5	63,0
	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. €)	-114,3	-139,1
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	50	30
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	168,3	354,7
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.	%	-	-

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

Hypothekendarlehenpfandbriefe

	Q4 2023	Q4 2022
ISIN	XS2689094279, DE000DK0JTY3, XS2517101478, DE000DK010T3, DE000DK0JTX5, DE000DK0JTZ0, DE000DK0T061, DE000DK011K0, DE000DK0YUH5, DE000DK0JTW7, DE000DK0YUR4, DE000DK0YUS2, DE000DK0T095	DE000DK010T3, DE000DK0JTW7, DE000DK0JTX5, DE000DK0JTY3, DE000DK0JTZ0, DE000DK0T061, DE000DK0T095, DE000DK0T7L8, DE000DK0YUH5, DE000DK0YUR4, DE000DK0YUS2, XS2517101478

Öffentliche Pfandbriefe

	Q4 2023	Q4 2022
ISIN	XS2502402360, XS2109453691, XS1875412980, XS1952579495, XS2021499871, XS2051657463, XS2332799431, XS2366703259, XS2449929194, XS2529513850, XS2537088598, XS2579303780	DE000DK0JTS5, DE000DK0JTV9, DE000DK0YUK9, XS1760125283, XS1875412980, XS1952579495, XS2021499871, XS2051657463, XS2109453691, XS2332799431, XS2366703259, XS2449929194, XS2502402360, XS2529513850, XS2537088598