

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 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. €)	24.628,1	22.608,6	22.025,5	23.733,4	20.960,2	22.380,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	30.663,5	29.793,7	29.102,9	32.785,7	27.735,3	30.997,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	6.035,4	7.185,1	7.077,4	9.052,3	6.775,1	8.616,7
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,5	31,8	32,1	38,1	32,3	38,5
Gesetzliche Überdeckung***	(Mio. €)	975,3	-	921,4	-	-	-
Vertragliche Überdeckung***	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung***	(Mio. €)	5.060,1	-	6.156,0	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	6.035,4	7.185,1	7.077,4	9.052,3		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,5	31,8	32,1	38,1		

* 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. €)	3.469,0	3.170,4	3.394,5	3.449,6	3.300,3	3.401,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.717,6	5.818,8	5.583,4	6.382,5	5.343,3	6.158,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.248,6	2.648,4	2.188,9	2.932,9	2.043,0	2.757,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		64,8	83,5	64,5	85,0	61,9	81,1
Gesetzliche Überdeckung***	(Mio. €)	139,8	-	135,7	-	-	-
Vertragliche Überdeckung***	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung***	(Mio. €)	2.108,8	-	2.053,2	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	2.248,6	2.648,4	2.188,9	2.932,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		64,8	83,5	64,5	85,0		

* 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

Hypothekendarlehen	Q3 2022		Q3 2021		Q3 2022	Q3 2021**
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	FäV (12 Monate)*	FäV (12 Monate)*
Restlaufzeit:	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Pfandbriefumlauf	Pfandbriefumlauf
					Mio. €	Mio. €
<= 0,5 Jahre	233,5	1.167,0	1.450,0	1.006,4	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.734,0	1.455,0	668,0	1.552,1	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	934,2	1.191,9	226,3	1.126,6	233,5	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	1.510,5	1.557,6	734,0	1.488,5	1.734,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.532,0	3.117,1	2.444,7	2.585,5	2.444,7	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	2.260,0	3.161,6	1.526,5	3.112,4	1.532,0	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	2.367,4	2.829,1	2.255,0	3.024,3	2.260,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	9.860,1	9.271,0	8.839,2	9.470,5	10.619,0	-
> 10 Jahre	4.196,4	6.913,2	4.464,9	6.427,4	5.804,9	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2022		Q3 2021		Q3 2022	Q3 2021**
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	FäV (12 Monate)*	FäV (12 Monate)*
Restlaufzeit:	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Pfandbriefumlauf	Pfandbriefumlauf
					Mio. €	Mio. €
<= 0,5 Jahre	113,9	427,4	397,8	333,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	687,0	257,8	759,3	611,4	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	903,6	301,2	109,0	441,9	113,9	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	40,5	307,3	187,0	339,4	687,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	96,3	622,3	944,1	513,2	944,1	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	123,0	792,2	96,3	517,9	96,3	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.015,0	440,1	123,0	687,3	123,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	150,7	1.848,6	164,9	1.648,4	1.165,7	-
> 10 Jahre	339,0	720,7	389,0	725,4	339,0	-

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. 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. €	10.645,1	10.908,2
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	5.418,8	4.961,8
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	6.639,9	6.362,0
Mehr als 10 Mio. €	7.102,7	6.596,0
Summe	29.806,5	28.828,0

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

Deckungswerte	Q3 2022 Mio. €	Q3 2021 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	1.036,0	1.134,1
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	1.806,6	1.853,8
Mehr als 100 Mio. €	2.875,0	2.830,9
Summe	5.717,6	5.818,8

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 rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	3. Quartal	Insgesamt																
		Wohnwirtschaftlich							Gewerblich									
		Insgesamt							Insgesamt									
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	29.806,5	21.267,2	4.955,3	8.967,7	7.211,8	63,9	68,5	8.539,3	4.753,9	2.573,7	327,8	692,1	64,9	126,9	0,2	0,8	
	Jahr 2021	28.828,0	20.415,5	4.821,3	8.583,6	6.890,7	61,2	58,7	8.412,5	4.529,0	2.582,9	307,1	715,3	202,8	75,4	0,1	0,1	
Deutschland	Jahr 2022	29.806,5	21.267,2	4.955,3	8.967,7	7.211,8	63,9	68,5	8.539,3	4.753,9	2.573,7	327,8	692,1	64,9	126,9	0,2	0,8	
	Jahr 2021	28.827,8	20.415,3	4.821,3	8.583,4	6.890,7	61,2	58,7	8.412,5	4.529,0	2.582,9	307,1	715,3	202,8	75,4	0,1	0,1	
Frankreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2021	0,2	0,2	-	0,2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

3. Quartal 2022

Deckungswerte											
Staat	3. 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 2022	5.717,6	1.254,1	20,0	1.025,9	2.816,9	38,0	1.309,1	287,5	220,2	-
	Jahr 2021	5.818,8	1.268,0	20,0	1.302,5	2.638,0	10,9	1.288,0	306,0	253,4	-
Deutschland	Jahr 2022	5.204,9	761,4	-	1.025,9	2.816,9	38,0	816,4	287,5	220,2	-
	Jahr 2021	5.347,5	836,7	-	1.302,5	2.638,0	10,9	836,7	306,0	253,4	-
Dänemark	Jahr 2022	13,1	13,1	-	-	-	-	13,1	-	-	-
	Jahr 2021	14,1	14,1	-	-	-	-	14,1	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	272,0	272,0	-	-	-	-	272,0	-	-	-
	Jahr 2021	259,8	259,8	-	-	-	-	259,8	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	191,4	191,4	-	-	-	-	191,4	-	-	-
	Jahr 2021	138,7	138,7	-	-	-	-	138,7	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	20,0	-	20,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	40,0	-	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	16,2	16,2	-	-	-	-	16,2	-	-	-
	Jahr 2021	18,7	18,7	-	-	-	-	18,7	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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	Mio. €	davon			Mio. €	Mio. €		
			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
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €				
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	857,0	-	-	-	-	857,0		
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-		
Deutschland	Jahr 2022	857,0	-	-	-	-	857,0		
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-		

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
			Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013						
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten		-	-	-	-	-	-	-		
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-		
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-		
Deutschland		-	-	-	-	-	-	-		
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-		
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-		

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

3. Quartal 2022

Hypothekendarlehen			Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe		(Mio. €)	24.628,1	22.608,6
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)		%	98,9	98,8
Deckungsmasse		(Mio. €)	30.663,5	29.793,7
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		%	83,0	82,3
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	6,9	7,0
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3		%	42,1	41,7
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. €)	-74,1	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	60,0	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	782,0	-
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.	%	0,0	-

Öffentliche Pfandbriefe

		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	3.469,0	3.170,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	99,9	99,8
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.717,6	5.818,8
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	%	71,5	68,6
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	224,2	-64,1
	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. €)	-38,7	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	31,0	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	157,2	-
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.

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

Hypothekendarlehenpfandbriefe		
	Q3 2022	Q3 2021*
ISIN	DE000HV2AY12, DE000HV2AY04, DE000HV2AYZ8, DE000HV2AYY1, DE000HV2AYW5, DE000HV2AYV7, DE000HV2AYT1, DE000HV2AYS3, DE000HV2AYQ7, DE000HV2AYN4, DE000HV2AYJ2, DE000HV2AYH6, DE000HV2AYF0, DE000HV2AYE3, DE000HV2AYD5, DE000HV2AXS4, DE000HV2ATM4, DE000HV2ATP9, DE000HV2ATM6, DE000HV2ATJ2, DE000HV2AYA1, DE000HV2AS85, DE000HV2AS44, DE000HV2AS10, DE000HV2AS28, DE000HV2AS20, DE000HV2ASW7, DE000HV2ASU1, DE000HV2AST3, DE000HV2ASF2, DE000HV2AR94, DE000HV2ASK2, DE000HV2AR52, DE000HV2ARX7, DE000HV2ARV1, DE000HV2ARR9, DE000HV2ARC1, DE000HV2ARE7, DE000HV2ARF4, DE000HV2ARM0, DE000HV2AQ79, DE000HV2AQ38, DE000HV2ART5, DE000HV2AQ04, DE000HV2AQ24, DE000HV2AQW1, DE000HV2AQD1, DE000HV2APN2, DE000HV2APC5, DE000HV2AN98, DE000HV2AP99, DE000HV2AN80, DE000HV2AN56, DE000HV2ANM9, DE000HV2AND8, DE000HV2AMT6, DE000HV2AMJ7, DE000HV2AMH1, DE000HV2AL33, DE000HV2AL17, DE000HV2ALG5, DE000HV2ALB6, DE000HV2AL88, DE000HV2AK91, DE000HV2AK67, DE000HV2AK18, DE000HV2AKY0, DE000HV2AK00, DE000HV2AKPB, DE000HV2AKN3, DE000HV0ECZ0, DE000HV0EC08, DE000HV2J6F0	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q3 2022	Q3 2021*
ISIN	DE000HV2AYX3, DE000HV2AYU9, DE000HV2ATC7, DE000HV2ARJ6, DE000HV2ARK4	-

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