

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
<b>Hypothekendarfandbriefe</b>	(Mio. €)	26.166,7	25.458,7	23.662,0	24.974,1	22.611,7	23.656,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	31.483,9	29.941,3	29.551,5	31.017,2	28.156,5	29.406,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	5.317,2	4.482,6	5.889,5	6.043,1	5.544,8	5.750,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		20,3	17,6	24,9	24,2	24,5	24,3
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	1.046,9	-	473,2	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	4.270,3	-	5.416,3	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	5.317,2	4.482,6	5.889,5	6.043,1	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		20,3	17,6	24,9	24,2	-	-

\* 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*	
		Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	4.222,1	5.296,0	4.142,7	5.442,2	4.024,6	5.360,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	6.501,3	6.309,6	6.451,9	6.592,4	6.043,5	6.393,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	2.279,2	1.013,6	2.309,2	1.150,2	2.018,9	1.033,1
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		54,0	19,1	55,7	21,1	50,2	19,3
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	172,1	-	82,9	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	2.107,1	-	2.226,3	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	2.279,2	1.013,6	2.309,2	1.150,2	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		54,0	19,1	55,7	21,1	-	-

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

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

<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

<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**  
**1. Quartal 2023**

Hypothekendarlehen	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023	Q1 2022**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
<b>Restlaufzeit:</b>						
<= 0,5 Jahre	741,1	1.264,8	675,2	1.258,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.434,2	1.448,8	1.226,3	1.357,8	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.510,5	1.346,4	1.734,0	1.250,8	741,1	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	678,5	1.531,3	934,2	1.378,0	1.434,2	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	2.680,5	3.007,1	2.187,0	2.824,8	2.189,0	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	3.696,2	3.658,9	1.675,0	2.754,9	2.680,5	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	3.001,7	2.523,4	2.195,3	3.415,1	3.696,2	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	9.247,1	9.461,9	10.612,3	8.963,9	11.095,3	-
> 10 Jahre	3.176,9	7.241,3	4.219,4	6.737,1	4.330,4	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023	Q1 2022**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
<b>Restlaufzeit:</b>						
<= 0,5 Jahre	191,0	276,3	781,9	612,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	903,6	335,4	1.109,4	451,0	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	40,5	321,5	687,0	387,2	191,0	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	85,0	369,4	903,6	393,0	903,6	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.319,3	706,8	125,5	749,5	125,5	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.065,0	736,6	69,3	620,9	1.319,3	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	10,0	517,9	1.070,0	613,4	1.065,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	145,7	1.743,1	160,3	1.736,7	153,7	-
> 10 Jahre	462,0	1.494,3	389,0	745,0	464,0	-

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.

**Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen**  
**1. Quartal 2023**

Deckungswerte	Q1 2023 Mio. €	Q1 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	10.511,5	10.800,2
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	5.714,6	5.211,2
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	7.002,8	6.481,8
Mehr als 10 Mio. €	7.597,8	6.891,1
<b>Summe</b>	<b>30.826,7</b>	<b>29.384,3</b>

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

Deckungswerte	Q1 2023 Mio. €	Q1 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	1.038,3	1.078,5
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	1.809,9	1.717,9
Mehr als 100 Mio. €	3.653,1	3.513,2
<b>Summe</b>	<b>6.501,3</b>	<b>6.309,6</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.**

**1. 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	1. Quartal	Insgesamt		davon						Gewerblich							
		Mio. €	Mio. €	Wohnwirtschaftlich						Insgesamt	davon						
				Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
				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. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	30.826,7	21.818,8	5.057,9	9.201,2	7.442,8	62,9	54,0	9.007,9	5.046,4	2.749,5	361,5	694,2	69,9	86,4	0,2	0,7
	Jahr 2022	29.384,3	20.798,5	4.910,7	8.785,1	6.976,8	60,9	65,0	8.585,8	4.587,1	2.667,9	304,8	696,7	160,9	168,4	0,1	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	30.826,7	21.818,8	5.057,9	9.201,2	7.442,8	62,9	54,0	9.007,9	5.046,4	2.749,5	361,5	694,2	69,9	86,4	0,2	0,7
	Jahr 2022	29.384,2	20.798,4	4.910,7	8.785,0	6.976,8	60,9	65,0	8.585,8	4.587,1	2.667,9	304,8	696,7	160,9	168,4	0,1	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	0,1	0,1	-	0,1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen**

**1. Quartal 2023**

<b>Deckungswerte</b>											
Staat	1. 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. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	6.501,3	1.256,5	20,0	1.626,4	3.036,3	36,7	1.311,5	281,1	189,3	-
	Jahr 2022	6.309,6	1.261,6	20,0	1.801,2	2.643,5	29,6	1.281,6	297,7	236,0	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	6.052,6	827,8	-	1.626,4	3.036,3	36,7	882,8	281,1	189,3	-
	Jahr 2022	5.818,3	810,3	-	1.801,2	2.643,5	29,6	810,3	297,7	236,0	-
<b>Dänemark</b>	Jahr 2023	11,5	11,5	-	-	-	-	11,5	-	-	-
	Jahr 2022	13,4	13,4	-	-	-	-	13,4	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2023	232,5	232,5	-	-	-	-	232,5	-	-	-
	Jahr 2022	253,8	253,8	-	-	-	-	253,8	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	Jahr 2023	169,7	169,7	-	-	-	-	169,7	-	-	-
	Jahr 2022	166,6	166,6	-	-	-	-	166,6	-	-	-
<b>Österreich</b>	Jahr 2023	20,0	-	20,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	40,0	-	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-
<b>Schweiz</b>	Jahr 2023	15,0	15,0	-	-	-	-	15,0	-	-	-
	Jahr 2022	17,5	17,5	-	-	-	-	17,5	-	-	-

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen  
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt  
1. 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			
			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. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen**  
**1. Quartal 2023**

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	1. 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	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. €	
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>		Jahr 2023	657,2	-	-	-	-	657,2
		Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>		Jahr 2023	657,2	-	-	-	-	657,2
		Jahr 2022	-	-	-	-	-	-

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

**Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten**

**1. Quartal 2023**

<b>Hypothekendarlehen</b>		<b>Q1 2023</b>	<b>Q1 2022</b>
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	26.166,7	25.458,7
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	99,2	98,9
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	31.483,9	29.941,3
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 12 Abs. 1, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 S. 2, 2. Halbsatz überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenzen nach § 19 Abs. 1 S. 7 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%	82,6	82,6
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	-	-
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)	Jahre	6,8	7,0
§ 28 Abs. 2 Nr. 4			
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	%	42,4	41,8
§ 28 Abs. 2 Nr. 3			
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. €)	239,6	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	115	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	594,1	-
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	-

\* 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
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	4.222,1	5.296,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	99,9
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	6.501,3	6.309,6
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	%	74,6	71,7
Nettoarwert 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	307,5	-35,2
	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. €)	-	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	2	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	154,0	-

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  
1. Quartal 2023**

Hypothekendarlehenpfandbriefe		
	Q1 2023	Q1 2022*
ISIN	DE000HV2AY12, DE000HV2AY04, DE000HV2AYZ8, DE000HV2AYY1, DE000HV2AYW5, DE000HV2AYV7, DE000HV2AYT1, DE000HV2AYS3, DE000HV2AYN4, DE000HV2AYJ2, DE000HV2AYH6, DE000HV2AYF0, DE000HV2AYE3, DE000HV2AYD5, DE000HV2AX54, DE000HV2ATN4, DE000HV2ATP9, DE000HV2ATM6, DE000HV2ATJ2, DE000HV2AYA1, DE000HV2AS85, DE000HV2AS44, DE000HV2AS10, DE000HV2AS28, DE000HV2ASZ0, DE000HV2ASW7, DE000HV2ASU1, DE000HV2AST3, DE000HV2ASF2, DE000HV2AR94, DE000HV2ASK2, DE000HV2AR52, DE000HV2ARX7, DE000HV2ARV1, DE000HV2ARR9, DE000HV2ARC1, DE000HV2ARE7, DE000HV2ARF4, DE000HV2ARM0, DE000HV2AQ38, DE000HV2ART5, DE000HV2AQ04, DE000HV2AQZ4, DE000HV2AQW1, DE000HV2AQD1, DE000HV2APN2, DE000HV2APC5, DE000HV2AP99, DE000HV2AN56, DE000HV2ANM9, DE000HV2AND8, DE000HV2AMT6, DE000HV2AMJ7, DE000HV2AMH1, DE000HV2AL33, DE000HV2AL17, DE000HV2ALG5, DE000HV2ALB6, DE000HV2AK91, DE000HV2AK67, DE000HV2AK18, DE000HV2AKY0, DE000HV2AK00, DE000HV2AKP8, DE000HV2AKN3, DE000HV0EC08, DE000HV2J6F0, DE000HV2AY38, DE000HV2AY46, DE000HV2AY79, DE000HV2AZK7, DE000HV2AZC4	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q1 2023	Q1 2022*
ISIN	DE000HV2AYU9, DE000HV2ATC7, DE000HV2ARJ6, DE000HV2ARK4, DE000HV2AZG5	-

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