

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
3. Quartal 2023

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2023	Q3 2022	Q3 2023	Q3 2022	Q3 2023	Q3 2022
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	34.640,9	33.515,3	31.252,3	30.158,5	28.612,8	25.793,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	40.775,4	39.387,8	37.983,7	37.259,6	34.688,5	31.076,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	6.134,5	5.872,5	6.731,4	7.101,1	6.075,7	5.282,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,7	17,5	21,5	23,5	21,2	20,5
Gesetzliche Überdeckung, ¹	(Mio. €)	1.406,5	1.354,4	625,0	1.238,3		
Vertragliche Überdeckung, ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung, ³	(Mio. €)	4.728,0	4.518,1	6.106,3	5.862,8		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	6.134,5	5.872,5	6.731,4	7.101,1		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,7	17,5	21,5	23,5		

* 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 2023	Q3 2022	Q3 2023	Q3 2022	Q3 2023	Q3 2022
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	9.581,4	9.910,1	9.525,9	10.132,1	8.674,1	7.810,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.921,9	12.467,8	11.715,5	12.545,3	10.567,7	9.816,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.340,6	2.557,8	2.189,6	2.413,1	1.893,6	2.005,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,4	25,8	23,0	23,8	21,8	25,7
Gesetzliche Überdeckung, ¹	(Mio. €)	385,7	399,9	190,5	402,1		
Vertragliche Überdeckung, ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung, ³	(Mio. €)	1.954,9	2.157,9	1.999,1	2.011,1		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	2.340,6	2.557,8	2.189,6	2.413,1		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,4	25,8	23,0	23,8		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 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; Die Vorjahreskennzahl (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.

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

3. Quartal 2023

Hypothekentpfandbriefe	Q3 2023		Q3 2022		Q3 2023 FäV (12 Monate)*	Q3 2022 FäV (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	2.053,0	2.158,9	963,0	2.087,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	2.011,9	1.873,0	839,0	1.749,4	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	771,5	1.832,1	2.050,5	1.672,3	2.053,0	963,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	2.365,0	2.070,1	1.581,9	1.769,9	2.011,9	839,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	4.648,5	4.512,2	2.917,5	3.508,2	3.136,5	3.632,4
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	4.296,0	4.150,5	4.160,5	3.891,2	4.648,5	2.917,5
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	2.990,4	3.128,3	4.296,0	4.144,5	4.296,0	4.160,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	10.934,5	13.199,4	11.810,0	13.005,0	12.419,9	15.250,0
> 10 Jahre	4.570,1	7.851,0	4.896,9	7.559,4	6.075,1	5.752,9

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2023		Q3 2022		Q3 2023 FäV (12 Monate)*	Q3 2022 FäV (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	427,8	637,1	432,5	530,7	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	490,3	613,6	357,6	718,8	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	550,8	548,0	427,8	609,3	427,8	432,5
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	596,7	475,7	490,3	603,5	490,3	357,6
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	997,9	1.091,7	1.142,9	986,9	1.147,5	918,1
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	554,4	903,0	1.044,1	1.014,0	997,9	1.142,9
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.056,4	931,9	553,5	899,7	554,4	1.044,1
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.664,3	2.770,2	1.827,8	2.989,5	2.332,8	2.098,3
> 10 Jahre	3.242,7	3.950,9	3.633,6	4.115,5	3.630,7	3.916,6

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q3 2023	Q3 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	<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. 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.</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>	<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. 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.</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 ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen
3. Quartal 2023

Deckungswerte	Q3 2023 Mio. €	Q3 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	10.485,4	9.478,3
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	3.242,4	2.799,9
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	10.141,2	10.471,2
Mehr als 10 Mio. €	15.934,5	15.690,4
Summe	39.803,4	38.439,8

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

Deckungswerte	Q3 2023 Mio. €	Q3 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	5.555,1	5.728,5
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	4.123,5	4.300,2
Mehr als 100 Mio. €	2.243,3	2.439,1
Summe	11.921,9	12.467,8

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 2023

		Deckungswerte														Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
		Insgesamt	davon						Gewerblich								
			Wohnwirtschaftlich						Insgesamt								
			Insgesamt	davon						Insgesamt	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			
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	39.803,4	23.215,6	2.635,2	7.998,8	12.257,8	303,5	20,4	16.587,9	7.650,0	5.481,4	1.165,4	1.971,0	188,9	131,3	-	-
	Jahr 2022	38.439,8	21.915,7	2.109,3	7.097,3	12.412,2	270,0	27,0	16.524,1	7.295,3	4.626,0	226,5	4.176,1	192,4	7,9	-	-
Deutschland	Jahr 2023	38.470,3	23.207,3	2.635,1	7.998,6	12.249,7	303,5	20,4	15.263,1	6.832,3	5.142,7	1.078,6	1.897,2	181,0	131,3	-	-
	Jahr 2022	37.031,9	21.907,2	2.109,2	7.096,9	12.404,1	270,0	27,0	15.124,6	6.417,8	4.278,2	226,5	4.009,6	184,7	7,9	-	-
Frankreich	Jahr 2023	285,0	8,2	0,0	0,2	8,0	-	-	276,8	153,8	123,1	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	299,0	8,3	0,0	0,3	8,0	-	-	290,7	174,7	116,1	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2023	244,6	-	-	-	-	-	-	244,6	230,0	6,8	-	-	7,9	-	-	-
	Jahr 2022	270,1	-	-	-	-	-	-	270,1	253,1	9,2	-	-	7,7	-	-	-
Niederlande	Jahr 2023	696,7	0,1	-	0,1	-	-	-	696,6	429,7	117,0	77,0	72,9	-	-	-	-
	Jahr 2022	724,8	0,1	-	0,1	-	-	-	724,6	445,4	123,4	-	155,8	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2023	14,0	-	-	-	-	-	-	14,0	4,3	-	9,7	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	14,0	-	-	-	-	-	-	14,0	4,3	-	-	9,7	-	-	-	-
Polen	Jahr 2023	43,4	-	-	-	-	-	-	43,4	-	43,4	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	47,8	-	-	-	-	-	-	47,8	-	47,8	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2023	49,4	-	-	-	-	-	-	49,4	-	48,5	-	0,9	-	-	-	-
	Jahr 2022	52,3	-	-	-	-	-	-	52,3	-	51,3	-	1,0	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

3. 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	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	11.921,9	-	596,0	1.883,4	8.280,5	612,5	145,1	322,8	80,0	1,7
	Jahr 2022	12.467,8	-	597,1	2.244,1	8.524,3	566,6	91,1	340,1	100,8	3,8
Deutschland	Jahr 2023	10.461,0	-	26,0	1.253,3	8.242,9	546,1	145,1	165,9	80,0	1,7
	Jahr 2022	10.801,9	-	26,0	1.428,4	8.484,9	495,2	91,1	171,7	100,8	3,8
Belgien	Jahr 2023	68,0	-	45,0	23,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	68,0	-	45,0	23,0	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2023	40,0	-	40,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	40,0	-	40,0	-	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2023	106,9	-	10,0	91,6	5,3	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	115,0	-	10,0	98,8	6,2	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2023	7,4	-	7,4	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	7,4	-	7,4	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2023	442,6	-	417,6	25,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	443,7	-	418,7	25,0	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2023	308,6	-	50,0	204,3	30,0	-	-	24,2	-	-
	Jahr 2022	328,6	-	50,0	224,3	30,0	-	-	24,2	-	-
Schweiz	Jahr 2023	155,1	-	-	155,1	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	156,9	-	-	156,9	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2023	266,0	-	-	131,1	2,3	-	-	132,6	-	-
	Jahr 2022	435,1	-	-	287,7	3,2	-	-	144,2	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2023	66,4	-	-	-	-	66,4	-	-	-	-
	Jahr 2022	71,4	-	-	-	-	71,4	-	-	-	-

**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 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	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten											
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland											
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
3. 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								
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		Insgesamt	davon		
			gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Staat		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	972,0	-	-	-	-	972,0	
	Jahr 2022	948,0	-	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2023	972,0	-	-	-	-	972,0	
	Jahr 2022	948,0	-	-	-	-	-	

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
3. 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	3. Quartal	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		Insgesamt	davon		Insgesamt	davon	
				gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			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. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten		-	-	-	-	-	-	-	-		
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-		
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-		
Deutschland		-	-	-	-	-	-	-	-		
	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
3. Quartal 2023

Hypothekentpfandbriefe		Q3 2023	Q3 2022
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	34.640,9	33.515,3
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	99,5	99,5
Deckungsmasse	(Mio. €)	40.775,4	39.387,8
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	%	89,7	89,8
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro	CAD	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	214,0	213,8
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	45,0	43,5
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,3	5,1
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	54,0	54,2
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. €)	561,2	56,0
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	25	23
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	789,9	788,8
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

3. Quartal 2023

Öffentliche Pfandbriefe		Q3 2023	Q3 2022
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	9.581,4	9.910,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	95,5	93,3
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.921,9	12.467,8
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 3 überschreiten		-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%	97,7	97,9
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	23,1	28,2
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	52,1	52,9
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	23,3	19,8
	HKD	-	-
	JPY	25,8	29,2
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-31,5	10,3
	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. €)	96,7	115,4
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	81	176
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	999,7	1.257,4
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
3. Quartal 2023

Hypothekenpfandbriefe		
	Q3 2023	Q3 2022
ISIN	DE000A1REY59, DE000A1TNEQ7, DE000A1TNEX3, DE000A12TZF9, DE000A12T6Z8, DE000A12UGG2, DE000A13SR38, DE000A13SWZ1, DE000A14J5J4, DE000A14KKK3, DE000A14KKM9, DE000A14KKZ4, DE000A161ZL4, DE000A161ZQ3, DE000A2AASB4, DE000A2AAW12, DE000A2AAW53, DE000A2AAX03, DE000A2AAX11, DE000A2AAX45, DE000A2AAX60, DE000A2BPJ45, DE000A2BPJ78, DE000A2BPJ86, DE000A2E4UX0, DE000A2GSMH3, DE000A2GSMJ9, DE000A2GSMK7, DE000A2GSP31, DE000A2GSP49, DE000A2GSP56, DE000A2GSP64, DE000A2GSP80, DE000A2GSP98, DE000A2G9HD6, DE000A2G9HE4, DE000A2G9HF1, DE000A2G9HG9, DE000A2G9HJ3, DE000A2G9HK1, DE000A2G9HL9, DE000A2G9HM7, DE000A2G9HNS, DE000A2G9HQ8, DE000A2NB841, DE000A2TSDV6, DE000A2TSDW4, DE000A2TSDY0, DE000A2TSD06, DE000A2TSD55, DE000A288367, DE000A289PA7, DE000A289PB5, DE000A289PC3, DE000A289PD1, DE000A289PE9, DE000A289PG4, DE000A289PH2, DE000A3E5UT4, DE000A3E5UU2, DE000A3E5UY4, DE000A3E5U22, DE000A3H2TK9, DE000A3H2TQ6, DE000A3H2TR4, DE000A3MP601, DE000A3MP619, DE000A3MP627, DE000A3MP635, DE000A3MP643, DE000A3MP650, DE000A3MP668, DE000A3MP684, DE000A3MP692, DE000A3MQUV7, DE000A3MQUX3, DE000A3MQUY1, DE000A3MQUZ8, DE000A3MQU03, DE000A3MQU29, DE000A3MQU37, DE000A3MQU45, DE000A3MQU52, DE000A3MQU78, DE000A3MQU86, DE000A3MQU94, DE000A351XK8, DE000A351XL6	DE000A0SMD13, DE000A1REYU0, DE000A1REY26, DE000A1REY59, DE000A1REZE1, DE000A1REZQ5, DE000A1TNEQ7, DE000A1TNEX3, DE000A1X3M51, DE000A1X3M93, DE000A12TZF9, DE000A12T6Z8, DE000A12UGG2, DE000A13SR38, DE000A13SWR8, DE000A13SWZ1, DE000A14J5J4, DE000A14KKH9, DE000A14KKK3, DE000A14KKM9, DE000A14KKZ4, DE000A161ZL4, DE000A161ZQ3, DE000A161ZU5, DE000A2AASB4, DE000A2AAW12, DE000A2AAW53, DE000A2AAX03, DE000A2AAX11, DE000A2AAX45, DE000A2AAX60, DE000A2BPJ45, DE000A2BPJ78, DE000A2BPJ86, DE000A2E4UX0, DE000A2GSMH3, DE000A2GSMJ9, DE000A2GSMK7, DE000A2GSP31, DE000A2GSP49, DE000A2GSP56, DE000A2GSP64, DE000A2GSP80, DE000A2GSP98, DE000A2G9HA2, DE000A2G9HB0, DE000A2G9HC8, DE000A2G9HD6, DE000A2G9HE4, DE000A2G9HF1, DE000A2G9HG9, DE000A2G9HJ3, DE000A2G9HK1, DE000A2G9HL9, DE000A2G9HM7, DE000A2G9HNS, DE000A2G9HQ8, DE000A2NB841, DE000A2TSDV6, DE000A2TSDW4, DE000A2TSDY0, DE000A2TSD06, DE000A2TSD55, DE000A288367, DE000A289PA7, DE000A289PB5, DE000A289PC3, DE000A289PD1, DE000A289PE9, DE000A289PG4, DE000A289PH2, DE000A3E5UT4, DE000A3E5UU2, DE000A3E5UY4, DE000A3H2TK9, DE000A3H2TQ6, DE000A3H2TR4, DE000A3MP601, DE000A3MP619, DE000A3MP627, DE000A3MP635, DE000A3MP643, DE000A3MP650, DE000A3MP668, DE000A3MP684, DE000A3MP692, DE000A3MQUV7, DE000A3MQUX3, DE000A3MQUY5, DE000A3MQUX3,
Öffentliche Pfandbriefe		
	Q3 2023	Q3 2022
ISIN	DE000A0DLV76, DE000A0EUMF2, DE000A0EUMR7, DE000A0EUM42, DE000A0EUPJ7, DE000A0XFAE1, DE000A1TM6A4, DE000A1YC8G2, DE000A1YC8K4, DE000A12TYS2, DE000A14J5C9, DE000A161ZP5, DE000A2BPJ11, DE000A2BPJ29, DE000A2BPJ52, DE000A2BPJ60, DE000A2GSMC4, DE000A2TSDZ7, DE000A3MQU11, DE000A3MQU60	DE000A0DLV76, DE000A0EUMF2, DE000A0EUMR7, DE000A0EUM34, DE000A0EUM42, DE000A0EUPJ7, DE000A0XFAE1, DE000A1TM6A4, DE000A1YC8G2, DE000A1YC8K4, DE000A12TYS2, DE000A14J5C9, DE000A161ZP5, DE000A2BPJ11, DE000A2BPJ29, DE000A2BPJ52, DE000A2BPJ60, DE000A2GSMB6, DE000A2GSMC4, DE000A2TSDZ7,