



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 31. März 2022

# Inhalt

## **Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten**

**3**

Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten

16

Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten

26

Aufgrund von Rundungen können sich im vorliegenden Bericht bei Summenbildungen und bei der Berechnung von Prozentangaben geringfügige Abweichungen ergeben.

## Gesamtbetrag der umlaufenden Hypothekendarlehen und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021
Pfandbriefumlauf	9.387,1	1.988,5	9.399,3	2.123,2	8.668,5	1.889,2	10.262,9	2.419,8	8.668,5	1.889,2
Deckungsmasse	11.951,6	4.883,3	12.508,0	5.285,9	11.444,4	4.886,8	13.841,9	5.872,0	11.391,2	4.886,8
Überdeckung	2.564,5	2.894,8	3.108,7	3.162,8	2.775,9	2.997,6	3.579,0	3.452,1	2.722,7	2.997,6
Überdeckung in %	27,3	145,6	33,1	149,0	32,0	158,7	34,9	142,7	31,4	158,7

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2022	Q1 / 2021
CHF	10,7	-
GBP	574,3	-

## Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q1 / 2022	-	214,8	-	229,6	444,4
	Q1 / 2021	-	20,0	-	25,0	45,0
Belgien	Q1 / 2022	-	-	-	10,5	10,5
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-
Italien	Q1 / 2022	-	-	-	15,0	15,0
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-
Japan	Q1 / 2022	-	-	-	149,0	149,0
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Luxemburg	Q1 / 2022	-	-	-	130,2	130,2
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-
Niederlande	Q1 / 2022	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	25,0	-	-	25,0
USA	Q1 / 2022	-	-	-	45,0	45,0
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-

## Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>9.387,1</b>	<b>1.988,5</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	97,75	87,35
Anteil Derivate	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	<b>11.951,6</b>	<b>4.883,3</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	80,69	76,68
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen des § 13 Abs. 1 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt der seit der Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit in Jahren	6,3	7,6
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

## Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2022		Q1 / 2021	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	1.340,0	1.408,6	96,8	539,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	799,0	915,1	105,0	275,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	368,0	609,0	10,0	247,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	661,0	669,9	49,0	343,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.297,5	1.257,3	476,6	553,6
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	910,0	1.772,9	6,0	584,7
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.800,0	1.256,6	125,0	602,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.981,6	3.120,7	1.070,0	1.484,4
mehr als 10 Jahre	230,0	941,5	50,1	253,7
<b>Gesamt</b>	<b>9.387,1</b>	<b>11.951,6</b>	<b>1.988,5</b>	<b>4.883,3</b>

## Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
bis zu 300 Tsd €	1.270,5	1.281,4
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	506,3	550,5
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	3.035,1	1.929,6
mehr als 10 Mio €	6.345,6	1.051,8
<b>Gesamt</b>	<b>11.157,6</b>	<b>4.813,3</b>

## Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					Gesamt
		Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q1 / 2022	254,4	837,0	2.331,7	-	-	<b>3.423,2</b>
	Q1 / 2021	248,9	835,1	2.304,0	-	1,9	<b>3.389,9</b>
Belgien	Q1 / 2022	-	-	7,5	-	-	<b>7,5</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Q1 / 2022	4,1	13,0	191,0	-	-	<b>208,1</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Irland	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-

## Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					Gesamt
		Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Niederlande	Q1 / 2022	-	43,8	955,7	12,9	-	<b>1.012,4</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q1 / 2022	-	-	24,6	-	-	<b>24,6</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Polen	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
Spanien	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-
<b>Gesamt</b>	<b>Q1 / 2022</b>	<b>258,6</b>	<b>893,8</b>	<b>3.510,5</b>	<b>12,9</b>	-	<b>4.675,8</b>
	<b>Q1 / 2021</b>	<b>248,9</b>	<b>835,1</b>	<b>2.304,0</b>	-	<b>1,9</b>	<b>3.389,9</b>

## Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q1 / 2022	1.548,7	1.699,3	111,9	816,9	67,5	78,3	<b>4.322,5</b>
	Q1 / 2021	372,9	314,2	71,5	589,7	-	-	<b>1.348,3</b>
Belgien	Q1 / 2022	-	25,6	-	-	-	-	<b>25,6</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Q1 / 2022	190,5	192,7	-	40,1	14,0	-	<b>437,4</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Q1 / 2022	275,0	260,7	-	11,6	26,4	3,2	<b>577,0</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Irland	Q1 / 2022	24,0	18,4	-	-	-	-	<b>42,4</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Q1 / 2022	96,5	-	-	-	-	-	<b>96,5</b>
	Q1 / 2021	75,0	-	-	-	-	-	<b>75,0</b>

## Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Niederlande	Q1 / 2022	216,8	212,7	-	101,0	-	-	<b>530,5</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q1 / 2022	80,2	7,3	-	-	-	-	<b>87,5</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Q1 / 2022	127,1	143,1	-	22,5	-	-	<b>292,7</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Q1 / 2022	16,7	47,2	-	5,8	-	-	<b>69,7</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
<b>Gesamt</b>	<b>Q1 / 2022</b>	<b>2.575,6</b>	<b>2.607,0</b>	<b>111,9</b>	<b>997,8</b>	<b>108,0</b>	<b>81,5</b>	<b>6.481,8</b>
	<b>Q1 / 2021</b>	<b>447,9</b>	<b>314,2</b>	<b>71,5</b>	<b>589,7</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1.423,3</b>

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Deutschland	Q1 / 2022	0,1	0,9
	Q1 / 2021	0,1	0,1
Belgien	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Frankreich	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Großbritannien	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Irland	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Luxemburg	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Niederlande	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Österreich	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Polen	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
Spanien	Q1 / 2022	-	-
	Q1 / 2021	-	-
<b>Gesamt</b>	<b>Q1 / 2022</b>	<b>0,1</b>	<b>0,9</b>
	<b>Q1 / 2021</b>	<b>0,0</b>	<b>0,2</b>

\* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

# Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
<b>Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten</b>	<b>16</b>
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	26

## Gesamtbetrag der umlaufenden Öffentlichen Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021
Pfandbriefumlauf	12.037,0	9.716,7	13.603,8	11.813,6	11.811,8	10.114,0	15.969,7	14.032,3	11.802,3	10.114,0
Deckungsmasse	14.924,7	13.481,6	16.583,9	15.755,4	14.490,2	13.667,2	19.485,8	18.752,1	14.420,5	13.636,8
Überdeckung	2.887,7	3.764,9	2.980,2	3.941,8	2.678,4	3.553,2	3.516,1	4.719,9	2.618,2	3.522,8
Überdeckung in %	24,0	38,7	21,9	33,4	22,7	35,1	22,0	33,6	22,2	34,8

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2022	Q1 / 2021
CHF	75,0	-
GBP	126,7	-
JPY	29,3	29,6
USD	221,6	152,6

## Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe gemäß § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Deutschland	Q1 / 2022	-	402,4	155,0	402,4
	Q1 / 2021	-	615,7	185,0	615,7
Niederlande	Q1 / 2022	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	25,0	-	25,0

## Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>12.037,0</b>	<b>9.716,7</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	96,93	95,97
Anteil Derivate	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	<b>14.924,7</b>	<b>13.481,6</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	88,55	89,04
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten	-	-

## Laufzeitstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2022		Q1 / 2021	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	318,9	966,1	289,9	1.021,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	680,4	813,5	478,6	687,8
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	424,2	538,0	201,0	532,6
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	441,6	694,9	378,2	568,8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.025,5	1.578,3	600,0	1.238,2
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	834,4	1.191,5	919,1	1.105,6
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	2.183,7	1.964,8	547,4	1.105,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	3.801,4	3.515,4	4.309,8	4.104,2
mehr als 10 Jahre	2.326,8	3.662,2	1.992,6	3.117,4
<b>Gesamt</b>	<b>12.037,0</b>	<b>14.924,7</b>	<b>9.716,7</b>	<b>13.481,6</b>

## Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
bis zu 10 Mio €	2.679,7	2.844,9
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	5.298,1	5.198,0
mehr als 100 Mio €	6.544,6	4.797,9
<b>Gesamt</b>	<b>14.522,3</b>	<b>12.840,9</b>

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern  
(inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskör- perschaft	Örtliche Gebietskör- perschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskör- perschaft	Örtliche Gebietskör- perschaft	Sonstige		
Deutschland	Q1 / 2022	<b>11.464,6</b>	55,0	3.648,6	5.218,7	2.542,2	<b>1.493,1</b>	224,2	509,3	589,0	170,6	(129,2)	<b>12.957,7</b>
	Q1 / 2021	<b>10.687,4</b>	55,0	2.502,4	5.426,0	2.704,0	<b>1.391,9</b>	282,2	361,5	574,6	173,6	(251,0)	<b>12.079,3</b>
Belgien	Q1 / 2022	<b>200,0</b>	-	75,0	-	125,0	<b>58,3</b>	-	-	-	58,3	(58,3)	<b>258,3</b>
	Q1 / 2021	<b>10,0</b>	-	-	-	10,0	<b>66,9</b>	-	-	-	66,9	(66,9)	<b>76,9</b>
Dänemark	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	<b>68,7</b>	-	-	-	68,7	(48,3)	<b>68,7</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>72,6</b>	-	-	-	72,6	(52,2)	<b>72,6</b>
Finnland	Q1 / 2022	<b>13,0</b>	-	-	8,0	5,0	-	-	-	-	-	(-)	<b>13,0</b>
	Q1 / 2021	<b>5,0</b>	-	-	-	5,0	-	-	-	-	-	(-)	<b>5,0</b>
Frankreich	Q1 / 2022	<b>11,8</b>	-	-	-	11,8	<b>230,8</b>	230,5	-	0,2	-	(60,0)	<b>242,6</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>250,5</b>	250,5	-	-	-	(62,2)	<b>250,5</b>
Großbritannien	Q1 / 2022	<b>59,1</b>	-	-	-	59,1	-	-	-	-	-	(-)	<b>59,1</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>6,9</b>	6,9	-	-	-	(6,9)	<b>6,9</b>
Italien	Q1 / 2022	<b>30,0</b>	23,7	6,3	-	-	-	-	-	-	-	(-)	<b>30,0</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Japan	Q1 / 2022	<b>10,0</b>	-	-	10,0	-	-	-	-	-	-	(-)	<b>10,0</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Kanada	Q1 / 2022	<b>45,4</b>	-	14,4	-	31,0	-	-	-	-	-	(-)	<b>45,4</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Lettland	Q1 / 2022	<b>26,5</b>	-	-	26,5	-	-	-	-	-	-	(-)	<b>26,5</b>
	Q1 / 2021	<b>21,2</b>	-	-	21,2	-	-	-	-	-	-	(-)	<b>21,2</b>

## Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern (inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		
Luxemburg	Q1 / 2022	<b>128,6</b>	-	-	-	128,6	-	-	-	-	-	(-)	<b>128,6</b>
	Q1 / 2021	<b>10,0</b>	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-	(-)	<b>10,0</b>
Niederlande	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	<b>27,7</b>	27,7	-	-	-	(27,7)	<b>27,7</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>32,0</b>	32,0	-	-	-	(32,0)	<b>32,0</b>
Österreich	Q1 / 2022	<b>236,1</b>	230,5	-	5,6	-	<b>6,4</b>	6,4	-	-	-	(6,4)	<b>242,5</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>10,7</b>	10,7	-	-	-	(10,7)	<b>10,7</b>
Polen	Q1 / 2022	<b>29,6</b>	29,6	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	<b>29,6</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Schweden	Q1 / 2022	<b>8,0</b>	-	-	8,0	-	-	-	-	-	-	(-)	<b>8,0</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Schweiz	Q1 / 2022	<b>73,0</b>	-	73,0	-	-	<b>11,6</b>	-	-	-	11,6	(11,6)	<b>84,6</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>13,1</b>	-	-	-	13,1	(13,1)	<b>13,1</b>
Spanien	Q1 / 2022	<b>16,2</b>	-	-	-	16,2	-	-	-	-	-	(-)	<b>16,2</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
USA	Q1 / 2022	<b>86,6</b>	-	86,6	-	-	<b>187,3</b>	122,1	-	-	65,2	(122,1)	<b>273,9</b>
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	<b>262,7</b>	183,3	-	-	79,4	(183,3)	<b>262,7</b>
<b>Gesamt</b>	<b>Q1 / 2022</b>	<b>12.438,5</b>	<b>338,8</b>	<b>3.904,0</b>	<b>5.276,8</b>	<b>2.918,9</b>	<b>2.083,9</b>	<b>611,0</b>	<b>509,3</b>	<b>589,3</b>	<b>374,3</b>	<b>(463,5)</b>	<b>14.522,3</b>
	<b>Q1 / 2021</b>	<b>10.733,6</b>	<b>55,0</b>	<b>2.502,4</b>	<b>5.447,2</b>	<b>2.729,0</b>	<b>2.107,3</b>	<b>765,6</b>	<b>361,5</b>	<b>574,6</b>	<b>405,7</b>	<b>(678,3)</b>	<b>12.840,9</b>

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Deutschland	Q1 / 2022	6,2	-	-	-	(6,2)	2,6	-	-	-	(2,6)
	Q1 / 2021	4,4	-	-	-	(4,4)	4,4	-	-	-	(4,4)
Belgien	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Dänemark	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Finnland	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Frankreich	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Großbritannien	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Italien	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Japan	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Kanada	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Lettland	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Luxemburg	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Niederlande	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Österreich	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Polen	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweden	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweiz	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Spanien	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
USA	Q1 / 2022	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q1 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
<b>Gesamt</b>	<b>Q1 / 2022</b>	<b>6,2</b>	-	-	-	<b>(6,2)</b>	<b>2,6</b>	-	-	-	<b>(2,6)</b>
	<b>Q1 / 2021</b>	<b>2,8</b>	-	-	-	<b>(2,8)</b>	<b>6,1</b>	-	-	-	<b>(6,1)</b>

\* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

# Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	16
<b>Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten</b>	<b>26</b>

## Gesamtbetrag der umlaufenden Schiffspfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021	Q1 / 2022	Q1 / 2021
Pfandbriefumlauf	10,5	30,5	10,5	31,2	10,5	30,8	10,6	31,7	10,5	30,8
Deckungsmasse	40,0	40,0	39,9	41,0	38,1	38,4	42,8	45,5	38,1	38,4
Überdeckung	29,5	9,5	29,3	9,8	27,6	7,6	32,3	13,8	27,6	7,6
Überdeckung in %	281,0	31,1	278,6	31,3	262,7	24,6	305,4	43,5	262,7	24,6

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2022	Q1 / 2021
	-	-

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe gemäß § 26 Abs. 1 Nr. 2, Nr. 3 und Nr. 4 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2	Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q1 / 2022	-	-	-	40,0	40,0
	Q1 / 2021	-	-	-	40,0	40,0

## Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>10,5</b>	<b>30,5</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	4,76	67,21
Anteil Derivate	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	<b>40,0</b>	<b>40,0</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	57,50	57,50
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	30,4	-

## Laufzeitstruktur der Schiffspfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2022		Q1 / 2021	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	10,5	-	10,0	-
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	-	-	20,0	-
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	-	-	0,5	-
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	-	10,0	-	-
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	-	20,0	-	10,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	-	-	-	20,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	-	10,0	-	-
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	-	-	-	10,0
mehr als 10 Jahre	-	-	-	-
<b>Gesamt</b>	<b>10,5</b>	<b>40,0</b>	<b>30,5</b>	<b>40,0</b>

## Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
bis zu 500 Tsd €	-	-
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	-	-
mehr als 5 Mio €	-	-
<b>Gesamt</b>	-	-

## Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach See- und Binnenschiffen

in Mio €		Seeschiffe					Binnenschiffe	Gesamt
		Gesamt	davon					
			Bulker	Containerschiff	Mehrzweckfrachter	Tanker		
Deutschland	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2022	-	-	-	-	-	-	-
	Q1 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
<b>Gesamt</b>	<b>Q1 / 2022</b>	-	-	-	-	-	-	-
	<b>Q1 / 2021</b>	-	-	-	-	-	-	-

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q1 / 2022	Q1 / 2021
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	-	-