

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
4. Quartal 2022

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	9.100,1	9.524,6	8.527,6	9.846,6	7.907,1	9.013,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.801,0	12.259,9	11.411,7	13.291,8	10.486,4	12.074,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.700,9	2.735,3	2.884,1	3.445,2	2.579,3	3.061,1
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		29,7	28,7	33,8	35,0	32,6	34,0
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	352,7	-	170,6	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	2.348,1	-	2.713,6	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

* 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 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	11.696,3	12.090,9	11.656,8	14.504,9	10.226,0	12.547,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.626,8	15.303,0	13.517,5	17.941,6	11.797,8	15.518,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	1.930,5	3.212,1	1.860,7	3.436,7	1.571,8	2.971,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		16,5	26,6	16,0	23,7	15,4	23,7
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	457,0	-	233,1	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	1.473,5	-	1.627,6	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

* 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 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021
Schiffspfandbriefe	(Mio. €)	-	30,5	-	31,2	-	31,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	-	40,0	-	40,7	-	38,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	-	9,5	-	9,5	-	7,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	31,1	-	30,4	-	24,1
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

* 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.

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 2022

Hypothekendarlehen	Q4 2022		Q4 2021		Q4 2022	Q4 2021**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	1.106,1	1.469,9	827,5	1.596,7	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	588,0	822,9	629,0	714,4	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	852,0	757,8	1.106,0	900,5	1.106,1	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	520,5	751,9	588,0	490,9	588,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.395,0	1.495,9	1.372,5	1.352,2	1.372,5	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.325,0	1.577,5	895,0	1.395,2	1.395,0	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.001,5	1.168,9	1.395,0	1.516,0	1.325,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.135,1	2.936,1	2.461,5	3.276,5	2.961,5	-
> 10 Jahre	177,0	820,0	250,1	1.017,6	352,1	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q4 2022		Q4 2021		Q4 2022	Q4 2021**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	726,3	777,5	457,8	1.067,0	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	484,6	684,6	517,7	763,4	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	213,0	715,7	569,8	689,1	726,3	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	769,2	620,8	432,1	552,1	484,6	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	520,6	1.067,2	991,8	1.564,1	982,2	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.672,1	1.564,3	533,6	1.219,8	520,6	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.238,4	869,9	1.734,1	1.940,4	1.672,1	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.262,4	3.406,2	4.620,2	3.760,7	4.099,7	-
> 10 Jahre	2.809,8	3.920,6	2.233,8	3.746,2	3.210,9	-

Schiffspfandbriefe	Q4 2022		Q4 2021		Q4 2022	Q4 2021**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	-	-	30,5	-	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	-	-	-	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	-	-	-	-	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	-	-	-	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	-	-	10,0	-	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	-	-	20,0	-	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	-	-	-	-	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	-	-	10,0	-	-
> 10 Jahre	-	-	-	-	-	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe		
	Q4 2022	Q4 2021**
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 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
4. Quartal 2022

Deckungswerte	Q4 2022 Mio. €	Q4 2021 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	1.250,1	1.293,7
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	522,8	537,3
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.900,7	3.165,3
Mehr als 10 Mio. €	6.392,5	6.544,7
Summe	11.066,1	11.541,0

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

Deckungswerte	Q4 2022 Mio. €	Q4 2021 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	2.687,3	2.745,8
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	5.452,9	5.431,7
Mehr als 100 Mio. €	5.165,2	6.712,7
Summe	13.305,4	14.890,2

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 2022

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		davon						Gewerblich							
		Mio. €	Mio. €	Wohnwirtschaftlich		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	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	11.066,4	4.545,0	261,1	874,2	3.373,5	36,2	-	6.521,4	2.798,8	2.475,1	107,0	970,4	78,0	92,1	0,3	0,1
	Jahr 2021	11.541,2	4.769,2	265,4	907,1	3.596,7	-	-	6.772,0	2.924,4	2.712,8	108,5	1.014,7	-	11,6	0,1	0,4
Deutschland	Jahr 2022	7.640,8	3.268,4	257,0	829,3	2.182,1	-	-	4.372,4	1.712,6	1.610,8	107,0	788,6	64,0	89,4	-	0,1
	Jahr 2021	7.926,6	3.488,6	261,3	849,8	2.377,5	-	-	4.438,0	1.806,4	1.698,8	108,5	816,0	-	8,3	0,1	0,4
Belgien	Jahr 2022	33,1	7,5	-	-	7,5	-	-	25,6	-	25,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	33,1	7,5	-	-	7,5	-	-	25,6	-	25,6	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	652,3	196,0	4,1	13,4	178,5	-	-	456,3	259,3	140,9	-	42,1	14,0	-	-	-
	Jahr 2021	689,3	208,6	4,1	13,2	191,3	-	-	480,7	234,6	206,0	-	40,1	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	404,4	-	-	-	-	-	-	404,4	145,5	245,2	-	11,0	-	2,7	0,3	-
	Jahr 2021	646,2	26,7	-	-	26,7	-	-	619,5	291,9	312,6	-	11,7	-	3,3	-	-
Irland	Jahr 2022	42,4	-	-	-	-	-	-	42,4	24,0	18,4	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2022	171,5	-	-	-	-	-	-	171,5	171,5	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	96,5	-	-	-	-	-	-	96,5	96,5	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	1.515,2	1.048,5	-	31,5	980,8	36,2	-	466,7	205,9	159,9	-	100,9	-	-	-	-
	Jahr 2021	1.562,0	1.013,2	-	44,1	969,1	-	-	548,8	217,0	213,7	-	118,1	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	111,5	24,6	-	-	24,6	-	-	86,9	80,2	6,7	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	112,7	24,6	-	-	24,6	-	-	88,1	80,2	7,9	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2022	413,5	-	-	-	-	-	-	413,5	170,6	220,4	-	22,5	-	-	-	-
	Jahr 2021	362,2	-	-	-	-	-	-	362,2	157,1	182,6	-	22,5	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	81,7	-	-	-	-	-	-	81,7	29,2	47,2	-	5,3	-	-	-	-
	Jahr 2021	70,2	-	-	-	-	-	-	70,2	16,7	47,2	-	6,3	-	-	-	-
übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	42,4	-	-	-	-	-	-	42,4	24,0	18,4	-	-	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

4. Quartal 2022

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 2022	13.305,4	416,3	490,9	2.723,9	5.395,6	2.736,4	407,1	606,3	689,2	256,0
	Jahr 2021	14.890,4	637,8	361,1	3.981,6	5.229,8	3.007,5	737,5	550,3	618,2	404,4
Deutschland	Jahr 2022	11.682,7	180,4	10,0	2.482,1	5.343,9	2.378,2	230,6	591,8	543,8	102,3
	Jahr 2021	13.246,5	255,0	55,0	3.738,1	5.170,5	2.630,8	314,4	550,3	617,9	169,5
Belgien	Jahr 2022	244,6	44,6	-	75,0	-	125,0	-	-	-	44,6
	Jahr 2021	285,5	85,5	-	75,0	-	125,0	-	-	-	85,5
Dänemark	Jahr 2022	43,9	43,9	-	-	-	-	-	-	-	43,9
	Jahr 2021	68,3	47,9	-	-	-	-	-	-	-	68,3
Finnland	Jahr 2022	12,2	-	-	-	7,2	5,0	-	-	-	-
	Jahr 2021	13,0	-	-	-	8,0	5,0	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	265,5	55,5	-	-	-	11,3	94,3	14,5	145,4	-
	Jahr 2021	258,6	61,4	-	-	-	11,9	246,4	-	0,3	-
Großbritannien	Jahr 2022	56,4	-	-	-	-	56,4	-	-	-	-
	Jahr 2021	60,3	0,7	-	-	-	59,6	0,7	-	-	-
Italien	Jahr 2022	29,4	-	23,7	5,7	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	30,6	-	23,6	7,0	-	-	-	-	-	-
Lettland	Jahr 2022	22,5	-	-	-	22,5	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	27,7	-	-	-	27,7	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2022	128,2	-	-	-	-	128,2	-	-	-	-
	Jahr 2021	128,6	-	-	-	-	128,6	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	25,6	25,6	-	-	-	-	25,6	-	-	-
	Jahr 2021	51,0	29,9	21,1	-	-	-	29,9	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	437,6	4,8	428,8	-	4,0	-	4,8	-	-	-
	Jahr 2021	244,9	8,6	230,7	-	5,6	-	8,6	-	-	-
Polen	Jahr 2022	28,4	-	28,4	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	30,7	-	30,7	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2022	8,0	-	-	-	8,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	8,0	-	-	-	8,0	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	16,2	-	-	-	-	16,2	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	70,6	9,7	-	60,9	-	-	-	-	-	9,7
	Jahr 2021	83,7	11,3	-	72,4	-	-	-	-	-	11,3
Japan	Jahr 2022	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2022	47,3	-	-	15,0	-	32,3	-	-	-	-
	Jahr 2021	44,5	-	-	14,1	-	30,4	-	-	-	-
USA	Jahr 2022	192,5	51,8	-	85,2	-	-	51,8	-	-	55,5
	Jahr 2021	282,3	137,5	-	75,0	-	-	137,5	-	-	69,8

**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 2022**

Staat	4. Quartal	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
		Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	7,9	7,9	-	-	-	1,7	1,7	-	-	-
	Jahr 2021	6,3	6,3	-	-	-	3,5	3,5	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	7,9	7,9	-	-	-	1,7	1,7	-	-	-
	Jahr 2021	6,3	6,3	-	-	-	3,5	3,5	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
4. 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	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 2022	734,9	359,1	-	-	-	375,8
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	367,1	309,5	-	-	-	57,6
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2022	7,0	-	-	-	-	7,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2022	15,0	-	-	-	-	15,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2022	102,2	-	-	-	-	102,2
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	49,6	49,6	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Japan	Jahr 2022	149,0	-	-	-	-	149,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2022	45,0	-	-	-	-	45,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
4. 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	4. 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 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 2022	321,4	321,4	115,0	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	321,4	321,4	115,0	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-

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

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

4. Quartal 2022

Hypothekendarlehen		Q4 2022	Q4 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	9.100,1	9.524,6
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	97,7	97,5
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.801,0	12.259,9
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. 6 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	6,4	-
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	%	81,2	79,1
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	21,5	21,7
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	390,0	654,7
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	6,3	6,2
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	60,0	60,0
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. €)	331,2	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	53	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	-	-
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.	%	-	-

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

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

4. Quartal 2022

Öffentliche Pfandbriefe		Q4 2022	Q4 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	11.696,3	12.090,9
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	97,5	96,9
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.626,8	15.303,0
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	%	87,8	87,0
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	60,6	74,5
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	101,1	134,1
	HKD	-	-
	JPY	39,8	59,4
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	203,2	219,8
	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. €)	72,1	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	178	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	-	-

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.

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

4. Quartal 2022

Schiffspfandbriefe		Q4 2022	Q4 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	-	30,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	-	67,2
Deckungsmasse	(Mio. €)	-	40,0
davon Gesamtbetrag der Schiffshypotheken nach § 21, die die Grenzen nach § 22 Abs. 5 S. 2 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 26 Abs. 1, die die Grenzen nach § 26 Abs. 1 S. 6 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 5 überschreiten* § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	-	57,5
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	-	-	

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. €)	-	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	-	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 4 (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 4 (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
4. Quartal 2022

Hypothekendarlehenpfandbriefe		
	Q4 2022	Q4 2021*
ISIN	DE000BRL0385, DE000BRL0419, DE000BRL0435, DE000DHY4002, DE000DHY4614, DE000DHY4648, DE000DHY4861, DE000DHY4887, DE000DHY4945, DE000DHY4952, DE000DHY4960, DE000DHY4986, DE000DHY4994, DE000DHY5025, DE000DHY5074, DE000NLB0PB3, DE000NLB2TD7, DE000NLB3UX1, DE000NLB3ZY8, DE000NLB3ZZ5, DE000NLB3Z75	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q4 2022	Q4 2021*
ISIN	DE000BRL3041, DE000BRL3058, DE000BRL3157, DE000BRL3256, DE000BRL3264, DE000BRL3280, DE000BRL3298, DE000NLB1LD6, DE000NLB1VT1, DE000NLB2JX6, DE000NLB2Q36, DE000NLB8CC2, DE000NLB8EY2, DE000NLB8E83, DE000NLB85X6, DE000NLB8739	-

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