

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

3. Quartal 2026

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2026	Q3 2025	Q3 2026	Q3 2025	Q3 2026	Q3 2025
Hypothekendarbriefe	(Mio. €)	11.661,5	10.291,5	11.748,5	10.263,3	12.744,3	9.611,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	14.629,2	14.017,1	15.059,1	14.260,0	15.712,4	13.224,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.967,7	3.725,6	3.310,6	3.996,7	2.968,0	3.613,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,4	36,2	28,2	38,9	23,3	37,6
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	465,2	408,3	234,7	205,3		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	2.502,5	3.317,2	3.104,1	3.791,4		
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*	
		Q3 2026	Q3 2025	Q3 2026	Q3 2025	Q3 2026	Q3 2025
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	10.704,3	10.608,3	11.039,3	10.915,5	9.967,7	9.739,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.924,8	11.648,7	12.320,5	11.931,2	10.725,9	10.395,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	1.220,6	1.040,3	1.281,2	1.015,7	758,2	656,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		11,4	9,8	11,6	9,3	7,6	6,7
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	423,7	418,5	220,8	218,3		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	796,8	621,8	1.060,4	797,4		
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.

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
3. Quartal 2026

Hypothekenzinspfandbriefe	Q3 2026		Q3 2025		Q3 2026 FäV (12 Monate)*	Q3 2025 FäV (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	967,0	2.032,2	1.165,0	2.516,2	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	501,5	1.743,0	1.295,0	1.132,9	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.355,0	1.038,6	967,0	1.007,6	967,0	1.165,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	523,0	1.255,7	501,5	1.361,5	501,5	1.295,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	3.309,0	2.311,9	1.535,0	1.676,2	1.878,0	1.468,5
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.311,5	1.913,5	2.273,5	2.000,7	3.309,0	1.535,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.076,0	1.337,3	1.246,5	1.256,0	1.311,5	2.273,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.553,5	2.676,9	1.228,0	2.673,0	3.264,0	2.385,0
> 10 Jahre	65,0	320,0	80,0	392,8	430,5	169,5

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2026		Q3 2025		Q3 2026 FäV (12 Monate)*	Q3 2025 FäV (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	2.073,9	794,3	721,3	1.003,8	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	976,6	525,2	228,9	719,0	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	218,3	482,8	2.001,0	483,0	2.073,9	721,3
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	444,3	510,4	928,2	467,0	976,6	228,9
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	864,6	1.005,8	463,0	850,2	662,6	2.929,2
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	780,6	841,2	827,1	934,2	864,6	463,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	739,7	1.023,2	783,9	751,9	780,6	827,1
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.409,7	3.374,4	2.053,3	3.046,0	2.349,8	2.633,4
> 10 Jahre	2.196,4	3.367,5	2.601,7	3.393,7	2.996,1	2.805,5

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe		
	Q3 2026	Q3 2025
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.	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.	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 ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

3. Quartal 2026

Deckungswerte	Q3 2026 Mio. €	Q3 2025 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	1.194,3	1.196,2
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	479,6	485,7
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.592,2	2.609,9
Mehr als 10 Mio. €	9.629,1	9.071,3
Summe	13.895,2	13.363,1

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

3. Quartal 2026

Deckungswerte	Q3 2026 Mio. €	Q3 2025 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	2.334,6	2.382,1
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	6.056,8	5.994,2
Mehr als 100 Mio. €	3.098,4	2.902,4
Summe	11.489,8	11.278,7

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 2026

		Deckungswerte														Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
		Insgesamt	davon														
			Wohnwirtschaftlich						Gewerblich								
			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 2026	13.895,2	4.256,9	248,6	842,5	3.165,8	-	0,1	9.638,3	4.841,3	3.217,3	135,0	1.411,9	32,9	-	0,1	0,4
	Jahr 2025	13.363,1	4.208,0	250,0	862,9	3.074,6	-	20,4	9.155,1	4.753,3	2.878,8	140,0	1.350,4	32,7	-	0,5	0,2
Deutschland	Jahr 2026	7.723,8	2.943,8	245,6	821,5	1.876,6	-	0,1	4.780,0	2.082,8	1.568,9	106,0	989,5	32,9	-	0,1	0,4
	Jahr 2025	7.822,0	2.846,1	244,4	815,4	1.765,9	-	20,4	4.975,8	2.234,9	1.640,1	140,0	928,2	32,7	-	0,5	0,2
Belgien	Jahr 2026	84,4	-	-	-	-	-	-	84,4	66,4	18,1	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	92,4	-	-	-	-	-	-	92,4	73,9	18,5	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2026	902,4	150,8	1,6	-	149,2	-	-	751,6	470,1	265,8	-	15,7	-	-	-	-
	Jahr 2025	891,3	212,1	4,1	14,3	193,7	-	-	679,3	409,7	253,9	-	15,7	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2026	1.450,4	149,3	-	-	149,3	-	-	1.301,2	959,7	330,6	-	10,9	-	-	-	-
	Jahr 2025	1.196,9	120,3	-	-	120,3	-	-	1.076,5	805,8	259,8	-	10,9	-	-	-	-
Irland	Jahr 2026	175,9	-	-	-	-	-	-	175,9	129,1	20,6	-	26,3	-	-	-	-
	Jahr 2025	192,4	-	-	-	-	-	-	192,4	115,1	20,6	-	56,7	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2026	32,7	-	-	-	-	-	-	32,7	32,7	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	180,2	-	-	-	-	-	-	180,2	180,2	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2026	2.329,3	953,1	1,4	20,3	931,4	-	-	1.376,2	646,9	406,9	-	322,4	-	-	-	-
	Jahr 2025	2.099,7	1.004,1	1,5	32,5	970,1	-	-	1.095,6	551,0	228,2	-	316,5	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2026	143,6	59,9	-	0,6	59,3	-	-	83,7	58,8	24,8	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	114,3	25,3	-	0,7	24,6	-	-	89,1	58,8	30,3	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2026	801,8	-	-	-	-	-	-	801,8	324,6	425,8	29,0	22,5	-	-	-	-
	Jahr 2025	571,3	-	-	-	-	-	-	571,3	244,7	304,1	-	22,5	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2026	250,8	-	-	-	-	-	-	250,8	70,3	155,9	-	24,6	-	-	-	-
	Jahr 2025	202,5	-	-	-	-	-	-	202,5	79,2	123,4	-	-	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen**3. Quartal 2026**

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 2026	11.489,8	220,9	446,4	726,1	6.408,8	1.937,7	400,3	730,5	657,8	182,3
	Jahr 2025	11.278,7	257,7	445,5	822,6	5.922,6	1.861,6	502,3	894,9	641,9	187,2
Deutschland	Jahr 2026	10.319,0	162,6	-	592,3	6.402,3	1.822,3	277,1	583,4	497,7	143,9
	Jahr 2025	10.111,8	182,2	-	642,5	5.904,5	1.773,2	349,3	742,6	541,2	158,4
Belgien	Jahr 2026	157,9	7,1	-	75,0	-	-	32,9	50,0	-	-
	Jahr 2025	160,0	7,1	-	75,0	-	-	35,0	50,0	-	-
Dänemark	Jahr 2026	55,4	40,6	-	-	-	-	55,4	-	-	-
	Jahr 2025	84,8	68,4	-	-	-	-	84,8	-	-	-
Finnland	Jahr 2026	4,4	-	-	-	4,4	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	10,2	-	-	-	5,2	5,0	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2026	331,6	-	-	-	-	11,7	34,9	97,2	160,1	27,8
	Jahr 2025	276,3	-	-	-	-	11,4	33,1	102,2	100,6	28,8
Großbritannien	Jahr 2026	58,5	-	-	-	-	58,5	-	-	-	-
	Jahr 2025	57,2	-	-	-	-	57,2	-	-	-	-
Italien	Jahr 2026	33,9	-	28,9	5,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	32,5	-	27,5	5,0	-	-	-	-	-	-
Lettland	Jahr 2026	2,1	-	-	-	2,1	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	4,9	-	-	-	4,9	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2026	14,9	-	-	-	-	14,9	-	-	-	-
	Jahr 2025	14,8	-	-	-	-	14,8	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2026	395,0	-	395,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	395,0	-	395,0	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2026	22,4	-	22,4	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	23,0	-	23,0	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2026	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	8,0	-	-	-	8,0	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2026	1,2	1,2	-	-	-	-	-	-	-	1,2
	Jahr 2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2026	44,4	-	-	14,1	-	30,3	-	-	-	-
	Jahr 2025	43,0	-	-	43,0	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2026	49,0	9,4	-	39,6	-	-	-	-	-	9,4
	Jahr 2025	57,1	-	-	57,1	-	-	-	-	-	-

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 2026

		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 2026	3,7	3,7	-	-	-	41,4	41,4	-	-	-
	Jahr 2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2026	3,7	3,7	-	-	-	41,4	41,4	-	-	-
	Jahr 2025	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
3. Quartal 2026

		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	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2026	734,0	734,0	-	-	-	-
	Jahr 2025	654,0	654,0	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2026	734,0	734,0	-	-	-	-
	Jahr 2025	629,0	629,0	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2026	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2025	25,0	25,0	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
3. Quartal 2026

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2, § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis b), § 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 b)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4
			Insgesamt	davon	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. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2026	435,0	435,0	90,0	-	-	-
	Jahr 2025	370,0	370,0	125,0	-	-	-
Deutschland	Jahr 2026	435,0	435,0	90,0	-	-	-
	Jahr 2025	370,0	370,0	125,0	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

3. Quartal 2026

Hypothekenpfandbriefe		Q3 2026	Q3 2025
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	11.661,5	10.291,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	84,6	91,2
Deckungsmasse		14.629,2	14.017,1
davon die Summe der Forderungen nach § 12 Abs. 1, die die Grenze nach § 13 Abs. 1 S. 2, 2. Halbsatz überschreiten, sowie der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenze 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	%	66,3	68,8
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	12,0	23,4
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	1.214,1	996,5
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
	NZD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	4,7	5,1
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. €)	-	255,7
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	-	41
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	574,0	654,0
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Buchstabe d (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Buchstabe d (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

3. Quartal 2026

Öffentliche Pfandbriefe		Q3 2026	Q3 2025
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	10.704,3	10.608,3
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	94,4	97,6
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.924,8	11.648,7
davon die Summe der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenze 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	%	89,6	89,1
§ 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	53,1	51,1
	HKD	-	-
	JPY	26,0	27,0
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-50,8	99,3
	AUD	-	-
	NZD	-	-
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. €)	1.883,9	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	181	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	8.159,9	942,6
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 2026

Hypothekendarlehen		
	Q3 2026	Q3 2025
ISIN	DE000DHY5025, DE000DHY5074, DE000NLB2TD7, DE000NLB3ZY8, DE000NLB3Z75, DE000NLB34Y2, DE000NLB4RL0, DE000NLB4Y34, DE000NLB4621, DE000NLB5AA6, DE000NLB5BV0, DE000NLB5B06, DE000NLB5EY8, DE000NLB5FE7, DE000NLB51X8, DE000NLB51Z3, DE000NLB54B8, DE000NLB54C6, DE000NLB54D4, DE000NLB54E2, DE000NLB54F9, DE000NLB54G7, DE000NLB54K9, DE000NLB54L7, DE000NLB5503, DE000NLB57X5	DE000BRL0419, DE000DHY4960, DE000DHY5025, DE000DHY5074, DE000NLB2TD7, DE000NLB3UX1, DE000NLB3ZY8, DE000NLB3ZZ5, DE000NLB3Z75, DE000NLB34Y2, DE000NLB4RJ4, DE000NLB4RL0, DE000NLB4Y34, DE000NLB43T3, DE000NLB4621, DE000NLB5AA6, DE000NLB5BV0, DE000NLB5B06, DE000NLB5EY8, DE000NLB5FE7

Öffentliche Darlehen		
	Q3 2026	Q3 2025
ISIN	DE000NLB1LD6, DE000NLB34X4, DE000NLB4XE3, DE000NLB40E1, DE000NLB40F8, DE000NLB42D9, DE000NLB51V2, DE000NLB5107, DE000NLB5115, DE000NLB5123, DE000NLB54P8, DE000NLB54Q6, DE000NLB54R4, DE000NLB54S2, DE000NLB5511, DE000NLB5537, DE000NLB8CC2, DE000NLB85X6, DE000NLB8739, XS3418680255	DE000NLB1LD6, DE000NLB34X4, DE000NLB4XE3, DE000NLB40E1, DE000NLB40F8, DE000NLB42D9, DE000NLB51V2, DE000NLB8CC2, DE000NLB85X6, DE000NLB8739