

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

3. Quartal 2022

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021
Hypothekendarlehen	(Mio. €)	18.533,1	16.814,8	17.175,5	17.743,4	20.098,4	18.840,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	20.152,8	17.303,6	19.468,3	18.578,9	20.912,2	19.349,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	1.619,7	488,8	2.292,8	835,5	813,8	509,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		8,7	2,9	13,3	4,7	4,0	2,7
Gesetzliche Überdeckung***	(Mio. €)	774,0	-	759,7	-	787,2	-
Vertragliche Überdeckung***	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung***	(Mio. €)	845,7	-	1.533,1	-	26,7	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	1.619,7	488,8	2.292,8	835,5		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		8,7	2,9	13,3	4,7		

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021	Q3 2022	Q3 2021
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	200,0	210,0	217,2	272,6	187,0	256,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	253,4	219,4	267,5	313,6	194,9	281,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	53,4	9,4	50,3	41,0	7,9	24,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		26,7	4,5	23,2	15,0	4,2	9,7
Gesetzliche Überdeckung***	(Mio. €)	8,5	-	8,6	-	6,7	-
Vertragliche Überdeckung***	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung***	(Mio. €)	44,9	-	41,6	-	1,2	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	53,4	9,4	50,3	41,0		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		26,7	4,5	23,2	15,0		

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

** Das gesetzliche Überdeckungserfordernis 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.

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

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
3. Quartal 2022

Hypothekendarlehen

	Q3 2022		Q3 2021	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	1.196,7	3.315,0	803,3	2.001,3
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	807,3	622,9	1.454,5	589,6
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.300,0	1.183,0	1.196,2	930,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	635,0	968,6	807,3	498,1
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	3.221,0	2.593,0	1.935,0	1.901,8
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	3.209,2	2.545,9	2.047,0	1.990,6
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.217,0	2.125,6	2.750,0	1.831,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	5.575,5	6.423,8	4.155,0	7.067,5
> 10 Jahre	1.371,4	375,0	1.666,6	493,7

Q3 2022 FäV (12 Monate)*	Q3 2021** FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
1.196,7	-
807,3	-
1.935,0	-
3.221,0	-
3.209,2	-
5.670,0	-
2.493,9	-

Öffentliche Pfandbriefe

	Q3 2022		Q3 2021	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	9,0	31,1	-	10,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	0,3	10,0	0,3
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	10,0	0,3	9,0	0,3
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	0,5	-	0,2
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	20,0	14,6	10,0	0,9
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	15,0	0,4	20,0	3,6
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	96,0	5,5	15,0	0,4
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	50,6	96,0	53,0
> 10 Jahre	50,0	150,1	50,0	150,1

Q3 2022 FäV (12 Monate)*	Q3 2021** FäV (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
9,0	-
-	-
10,0	-
20,0	-
15,0	-
96,0	-
50,0	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	
	Q3 2022
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	<p>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.</p>
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. 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.</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 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.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG, § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG und § 28 Abs. 4 Nr. 1 a PfandBG

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen 3. Quartal 2022

Deckungswerte	Q3 2022 Mio. €	Q3 2021 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	23,4	29,5
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	79,7	95,3
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.260,2	2.366,4
Mehr als 10 Mio. €	14.147,1	13.612,4
Summe	16.510,4	16.103,6

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen 3. Quartal 2022

Deckungswerte	Q3 2022 Mio. €	Q3 2021 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	11,6	11,4
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	211,0	200,0
Mehr als 100 Mio. €	-	-
Summe	222,6	211,4

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 2022

		Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt	
Staat	3. Quartal	Insgesamt		davon Wohnwirtschaftlich					Gewerblich					Bauplätze				
		Insgesamt	davon	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze	Insgesamt	davon								
										Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude		Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten			
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten		Jahr 2022	16.510,4	5.640,3	31,1	154,0	5.455,2	-	-	10.870,1	5.691,9	3.234,8	111,6	1.673,4	106,4	52,0	0,0	-
		Jahr 2021	16.103,6	5.368,7	17,3	159,2	5.187,9	-	4,3	10.734,9	5.740,4	3.039,0	94,7	1.592,1	123,8	144,9	-	-
Deutschland		Jahr 2022	11.201,8	4.939,9	30,8	9,0	4.900,1	-	-	6.261,9	2.852,8	1.868,2	107,6	1.274,9	106,4	52,0	-	-
		Jahr 2021	10.963,9	4.819,4	17,1	9,8	4.788,2	-	4,3	6.144,5	2.792,6	1.823,7	65,8	1.193,7	123,8	144,9	-	-
Belgien		Jahr 2022	55,7	-	-	-	-	-	-	55,7	55,7	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2021	120,2	-	-	-	-	-	-	120,2	120,2	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich		Jahr 2022	1.320,1	-	-	-	-	-	-	1.320,1	906,7	319,3	-	94,1	-	-	-	-
		Jahr 2021	1.357,6	-	-	-	-	-	-	1.357,6	926,9	336,6	-	94,1	-	-	-	-
Großbritannien		Jahr 2022	64,6	-	-	-	-	-	-	64,6	64,6	-	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2021	90,4	-	-	-	-	-	-	90,4	66,2	24,2	-	-	-	-	-	-
Niederlande		Jahr 2022	2.720,3	700,3	0,2	145,0	555,1	-	-	2.020,0	1.074,1	704,5	4,0	237,4	-	-	-	-
		Jahr 2021	2.450,9	549,2	0,2	149,3	399,7	-	-	1.901,7	1.110,7	524,9	28,9	237,2	-	-	-	-
Polen		Jahr 2022	900,5	-	-	-	-	-	-	900,5	562,3	271,1	-	67,1	-	-	-	-
		Jahr 2021	873,0	-	-	-	-	-	-	873,0	548,1	257,8	-	67,1	-	-	-	-
Tschechien		Jahr 2022	247,4	-	-	-	-	-	-	247,4	175,7	71,7	-	-	-	-	-	-
		Jahr 2021	247,4	-	-	-	-	-	-	247,4	175,7	71,7	-	-	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

3. Quartal 2022

		Deckungswerte									
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	222,6	-	50,0	164,0	-	-	-	8,6	-	-
	Jahr 2021	211,4	-	50,0	150,0	-	-	-	11,4	-	-
Deutschland	Jahr 2022	172,6	-	-	164,0	-	-	-	8,6	-	-
	Jahr 2021	161,4	-	-	150,0	-	-	-	11,4	-	-
Osterreich	Jahr 2022	50,0	-	50,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	50,0	-	50,0	-	-	-	-	-	-	-

**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 2022**

Staat	3. 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. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen

3. 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	3. Quartal	Summe	davon				
		Mio. €	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 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. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	3.642,4	0,0	0,0	2.136,9	0,0	1.505,5
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	3.327,9	0,0	0,0	2.136,9	0,0	1.191,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	314,5	0,0	0,0	0,0	0,0	314,5
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-

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

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe

3. 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	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. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	30,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	30,8	0,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	30,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	30,8	0,0
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 6, 7, 11, 12, 13, 14, 15 PfandBG und § 28 Abs. 2 S. 1 Nrn. 3, 4 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
3. Quartal 2022

Hypothekendarlehen		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	18.533,1	16.814,8
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	84,5	83,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	20.152,8	17.303,6
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*	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	77,1	76,5
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro			
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-217,8	68,8
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	67,0	94,8
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	4,2	3,9
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	57,3	56,4
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe - (Durchschnitt)	%	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	664,8	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	146,0	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	3.455,9	-
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.	%	-	-

Öffentliche Pfandbriefe			
		Q3 2022	Q3 2021
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	200,0	210,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	253,4	219,4
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	%	100,0	100,0
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*			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	11,6	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	157,0	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	43,7	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

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

**Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung
3. Quartal 2022**

Hypothekendarlehen	
	Q3 2022
ISIN	CH1202242249, DE000BHY0AU8, DE000BHY0BC4, DE000BHY0BE0, DE000BHY0BH3, DE000BHY0BN1, DE000BHY0BQ4, DE000BHY0BU6, DE000BHY0BV4, DE000BHY0BW2, DE000BHY0BZ5, DE000BHY0B06, DE000BHY0B14, DE000BHY0C13, DE000BHY0C47, DE000BHY0C70, DE000BHY0C88, DE000BHY0GC3, DE000BHY0GD1, DE000BHY0GE9, DE000BHY0GH2, DE000BHY0GK6, DE000BHY0GL4, DE000BHY0GX9, DE000BHY0HC1, DE000BHY0HK4, DE000BHY0HL2, DE000BHY0HM0, DE000BHY0HN8, DE000BHY0HP3, DE000BHY0HV1, DE000BHY0HW9, DE000BHY0HZ2, DE000BHY0H34, DE000BHY0JB9, DE000BHY0JC7, DE000BHY0JD5, DE000BHY0JJ2, DE000BHY0JS3, DE000BHY0JU9, DE000BHY0MQ1, DE000BHY0MT5, DE000BHY0MW9, DE000BHY0MX7, DE000BHY0SB0, DE000BHY0150, DE0002180064, DE0002190097, DE0002190204, DE0002190220, DE0002190253, DE0002190295, DE0002190303, DE0002190329, DE0002190337, DE0002190345, DE0002190402, DE0002190436, DE0002190444, DE0002190485, DE0002190543, DE0002190659, DE0002190725, DE0002190741, DE0002190782, DE0002190832, DE0002190972, DE0002191020, DE0002200003, DE0002200250, DE0002200359, DE0002200375, DE0002200409, DE0002200417, DE0002200425, DE0002200441, DE0002200458, DE0002200466, DE0002200516, DE0002200532, DE0002200557, DE0002200565, DE0002200573, DE0002200599, DE0002200615, DE0002200623, DE0002200649, DE0002200664, DE0002200672, DE0002200680, DE0002200698, DE0002200706, DE0002200714, DE0002200763, DE0002210028
	Q3 2021*
	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q3 2022	Q3 2021*
ISIN	DE0002193315, DE0002193372, DE0002193646, DE0002203023, DE0002203213, DE0002206737	-

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