

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

2. Quartal 2023

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2023	Q2 2022	Q2 2023	Q2 2022	Q2 2023	Q2 2022
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	9.144,1	8.627,1	8.575,8	8.388,6	7.923,3	7.740,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.329,1	10.956,7	12.920,0	11.104,7	11.840,3	10.141,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	4.185,0	2.329,6	4.344,2	2.716,1	3.917,0	2.400,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		45,8	27,0	50,7	32,4	49,4	31,0
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	354,1	-	171,5	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	3.830,9	-	4.172,7	-	-	-
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*	
		Q2 2023	Q2 2022	Q2 2023	Q2 2022	Q2 2023	Q2 2022
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	11.618,3	12.099,1	11.575,1	12.920,3	10.184,1	11.299,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.489,3	14.354,7	13.231,6	15.107,4	11.592,3	13.200,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	1.871,0	2.255,6	1.656,5	2.187,1	1.408,2	1.900,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		16,1	18,6	14,3	16,9	13,8	16,8
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	458,1	-	231,5	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	1.413,0	-	1.425,0	-	-	-
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.

** 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
2. Quartal 2023

Hypothekendarlehen	Q2 2023		Q2 2022		Q2 2023	Q2 2022**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	588,0	1.542,5	629,0	1.204,5	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	852,0	1.005,0	1.106,0	837,5	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	520,5	910,6	588,0	511,0	588,0	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	760,0	842,7	852,0	671,4	852,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.920,0	1.961,9	1.280,5	1.320,9	1.280,5	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.122,5	1.500,8	920,0	1.570,4	1.920,0	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.536,5	1.313,5	1.040,0	1.226,3	1.122,5	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.600,1	3.467,3	1.981,6	2.767,7	2.981,6	-
> 10 Jahre	244,5	755,0	230,0	846,9	399,5	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q2 2023		Q2 2022		Q2 2023	Q2 2022**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €	Fäv (12 Monate)* Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	498,9	1.176,5	521,1	992,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	346,4	735,7	704,4	562,0	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	764,7	648,4	432,1	669,2	498,9	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	604,3	609,2	225,5	660,7	346,4	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	742,5	1.124,5	1.022,2	1.244,9	1.369,0	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	2.198,2	1.518,4	770,8	1.297,0	742,5	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	550,4	784,9	2.241,2	1.854,3	2.198,2	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.988,8	3.163,8	3.823,6	3.438,8	3.385,8	-
> 10 Jahre	2.924,0	3.627,1	2.358,1	3.634,9	3.077,5	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q2 2023	Q2 2022**
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	<p>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.</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 ein 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
2. Quartal 2023

Deckungswerte	Q2 2023 Mio. €	Q2 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	1.268,3	1.264,0
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	534,9	512,3
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.939,5	2.888,6
Mehr als 10 Mio. €	7.808,4	5.567,4
Summe	12.551,1	10.232,3

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

Deckungswerte	Q2 2023 Mio. €	Q2 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	2.664,5	2.671,9
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	6.148,8	5.320,7
Mehr als 100 Mio. €	4.114,2	5.980,0
Summe	12.927,5	13.972,6

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.

2. Quartal 2023

Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	2. Quartal	Insgesamt		davon Wohnwirtschaftlich					Gewerblich								
		Mio. €	Mio. €	Insgesamt	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze	Insgesamt	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	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. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	12.551,1	4.619,8	269,7	889,0	3.422,5	15,0	23,6	7.931,3	3.743,8	2.693,8	105,5	1.203,1	101,7	83,5	0,9	0,1
	Jahr 2022	10.232,1	4.559,8	258,6	893,5	3.407,7	-	-	5.672,3	2.140,0	2.352,0	104,2	939,7	68,6	67,8	-	-
Deutschland	Jahr 2023	8.168,3	3.224,5	264,1	844,2	2.077,6	15,0	23,6	4.943,8	2.206,3	1.586,7	105,5	884,2	80,7	80,3	0,1	0,1
	Jahr 2022	7.410,6	3.386,7	254,5	837,0	2.295,2	-	-	4.023,9	1.371,7	1.650,2	104,2	778,6	54,6	64,6	-	-
Belgien	Jahr 2023	33,1	7,5	-	-	7,5	-	-	25,6	-	25,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	33,1	7,5	-	-	7,5	-	-	25,6	-	25,6	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2023	750,0	195,0	4,1	13,2	177,7	-	-	555,0	259,3	217,0	-	57,8	20,9	-	-	-
	Jahr 2022	574,0	194,9	4,1	12,8	178,0	-	-	379,1	190,5	134,5	-	40,1	14,0	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2023	879,9	56,0	-	-	56,0	-	-	823,9	451,8	357,5	-	11,4	-	3,2	0,9	-
	Jahr 2022	236,9	-	-	-	-	-	-	236,9	56,0	177,7	-	-	-	3,2	-	-
Irland	Jahr 2023	146,9	-	-	-	-	-	-	146,9	59,1	33,9	-	53,9	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2023	183,7	-	-	-	-	-	-	183,7	183,7	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	96,5	-	-	-	-	-	-	96,5	96,5	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2023	1.734,9	1.112,1	1,5	31,5	1.079,1	-	-	622,7	284,6	164,9	-	173,3	-	-	-	-
	Jahr 2022	1.380,9	946,1	-	43,7	902,4	-	-	434,8	190,9	151,2	-	92,7	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2023	90,1	24,6	-	-	24,6	-	-	65,5	58,8	6,7	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	112,1	24,6	-	-	24,6	-	-	87,5	80,2	7,3	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2023	476,2	-	-	-	-	-	-	476,2	199,3	254,4	-	22,5	-	-	-	-
	Jahr 2022	275,9	-	-	-	-	-	-	275,9	113,5	139,9	-	22,5	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2023	88,1	-	-	-	-	-	-	88,1	40,9	47,2	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	69,7	-	-	-	-	-	-	69,7	16,7	47,2	-	5,8	-	-	-	-
übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	42,4	-	-	-	-	-	-	42,4	24,0	18,4	-	-	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

2. Quartal 2023

Deckungswerte											
Staat	2. Quartal	Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		Mio. €	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	12.927,5	317,8	465,4	1.887,1	5.755,7	2.889,4	422,5	573,3	662,5	271,5
	Jahr 2022	13.972,4	533,2	337,0	3.317,1	5.322,5	2.834,3	627,2	548,4	591,7	394,2
Deutschland	Jahr 2023	11.443,6	182,9	10,0	1.642,8	5.717,9	2.537,9	332,5	558,9	535,1	108,4
	Jahr 2022	12.415,1	194,1	55,0	3.057,6	5.274,9	2.456,6	261,7	548,4	591,5	169,4
Belgien	Jahr 2023	250,4	50,4	-	75,0	-	125,0	-	-	-	50,4
	Jahr 2022	281,8	81,8	-	75,0	-	125,0	-	-	-	81,8
Dänemark	Jahr 2023	57,6	24,6	-	-	-	-	-	-	-	57,6
	Jahr 2022	67,4	47,0	-	-	-	-	-	-	-	67,4
Finnland	Jahr 2023	11,8	-	-	-	6,8	5,0	-	-	-	-
	Jahr 2022	12,6	-	-	-	7,6	5,0	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2023	191,8	-	-	-	-	11,7	38,3	14,4	127,4	-
	Jahr 2022	236,7	58,5	-	-	-	11,7	224,8	-	0,2	-
Großbritannien	Jahr 2023	58,3	-	-	-	-	58,3	-	-	-	-
	Jahr 2022	58,3	-	-	-	-	58,3	-	-	-	-
Italien	Jahr 2023	5,0	-	-	5,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	30,0	-	23,7	6,3	-	-	-	-	-	-
Lettland	Jahr 2023	19,8	-	-	-	19,8	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	25,2	-	-	-	25,2	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2023	103,4	-	-	-	-	103,4	-	-	-	-
	Jahr 2022	128,4	-	-	-	-	128,4	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2023	23,5	23,5	-	-	-	-	23,5	-	-	-
	Jahr 2022	27,7	27,7	-	-	-	-	27,7	-	-	-
Österreich	Jahr 2023	436,4	3,2	430,0	-	3,2	-	3,2	-	-	-
	Jahr 2022	241,2	6,4	230,0	-	4,8	-	6,4	-	-	-
Polen	Jahr 2023	25,5	-	25,5	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	28,3	-	28,3	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2023	8,0	-	-	-	8,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	16,2	-	-	-	-	16,2	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2023	69,6	8,3	-	61,3	-	-	-	-	-	8,3
	Jahr 2022	86,4	11,1	-	75,3	-	-	-	-	-	11,1
Japan	Jahr 2023	10,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-	-

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	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
	Jahr 2022	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2023	46,4	-	-	14,7	-	31,7	-	-	-	-
	Jahr 2022	48,5	-	-	15,4	-	33,1	-	-	-	-
USA	Jahr 2023	150,0	25,0	-	78,2	-	-	25,0	-	-	46,8
	Jahr 2022	258,6	106,6	-	87,5	-	-	106,6	-	-	64,5
übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2023	16,5	-	-	-	-	16,5	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
2. Quartal 2023**

Staat	2. Quartal	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
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	8,8	8,8	-	-	-	0,9	0,9	-	-	-
	Jahr 2022	7,1	7,1	-	-	-	2,6	2,6	-	-	-
Deutschland	Jahr 2023	8,8	8,8	-	-	-	0,9	0,9	-	-	-
	Jahr 2022	7,1	7,1	-	-	-	2,6	2,6	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
2. 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*							
Staat	2. 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 2023	748,2	533,9	-	-	-	214,3
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2023	529,0	484,0	-	-	-	45,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2023	5,3	-	-	-	-	5,3
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2023	15,0	-	-	-	-	15,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2023	49,9	49,9	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-
Japan	Jahr 2023	149,0	-	-	-	-	149,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
2. 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	2. Quartal	Mio. €	davon		davon		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	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	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. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2023	460,9	460,9	115,0	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2023	460,9	460,9	115,0	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-

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

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
2. Quartal 2023

Hypothekendarlehen		Q2 2023	Q2 2022
Umlaufende Pfandbriefe			
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	9.144,1	8.627,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	99,1	97,6
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.329,1	10.956,7
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 12 Abs. 1, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 S. 2, 2. Halbsatz überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenzen nach § 19 Abs. 1 S. 7 überschreiten	(Mio. €)	22,6	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%	77,4	83,6
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	-	-
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	19,6	11,1
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	706,2	223,5
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)	Jahre	5,7	6,5
§ 28 Abs. 2 Nr. 4			
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	%	60,0	60,0
§ 28 Abs. 2 Nr. 3			
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. €)	-	-
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 § 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.	%	0,2	-

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

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

2. Quartal 2023

Öffentliche Pfandbriefe		Q2 2023	Q2 2022
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	11.618,3	12.099,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	98,2	96,9
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.489,3	14.354,7
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	%	87,5	87,6
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	56,3	77,3
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	81,7	117,6
	HKD	-	-
	JPY	38,6	53,1
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	201,1	220,1
	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. €)	-	-
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 § 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.	%	0,0	-

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

**Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung
2. Quartal 2023**

Hypothekendarlehenpfandbriefe		
	Q2 2023	Q2 2022*
ISIN	DE000BRL0385, DE000BRL0419, DE000BRL0435, DE000DHY4648, DE000DHY4861, DE000DHY4887, DE000DHY4945, DE000DHY4952, DE000DHY4960, DE000DHY4986, DE000DHY4994, DE000DHY5025, DE000DHY5074, DE000NLB2TD7, DE000NLB3UX1, DE000NLB3ZY8, DE000NLB3ZZ5, DE000NLB3Z75, DE000NLB34Y2, DE000NLB4RJ4, DE000NLB4RLO	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q2 2023	Q2 2022*
ISIN	DE000BRL3157, DE000BRL3256, DE000BRL3264, DE000BRL3280, DE000BRL3298, DE000NLB1LD6, DE000NLB2JX6, DE000NLB2Q36, DE000NLB34V8, DE000NLB34X4, DE000NLB8CC2, DE000NLB8EY2, DE000NLB85X6, DE000NLB8739	-

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