

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
Hypothekendarbriefe	(Mio. €)	12.558,0	12.377,7	12.152,4	12.691,9	11.513,0	12.090,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	17.334,6	15.975,7	16.475,0	17.163,4	14.612,1	15.141,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	4.776,6	3.598,0	4.322,7	4.471,5	3.099,2	3.051,1
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		38,0	29,1	35,6	35,2	26,9	25,2
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	517,7	-	243,0	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	4.258,9	-	4.079,6	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	4.776,6	3.598,0	4.322,7	4.471,5	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		38,0	29,1	35,6	35,2	-	-

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021	Q4 2022	Q4 2021
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	10.141,8	10.812,0	9.986,0	11.647,5	9.273,0	10.801,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.464,5	12.150,6	12.445,5	13.885,8	11.208,5	12.274,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.322,8	1.338,6	2.459,5	2.238,3	1.935,5	1.472,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		22,9	12,4	24,6	19,2	20,9	13,6
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	415,0	-	199,7	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	1.907,7	-	2.259,8	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	2.322,8	1.338,6	2.459,5	2.238,3	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		22,9	12,4	24,6	19,2	-	-

* 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

4. Quartal 2022

Hypothekendarlehen	Q4 2022		Q4 2021		Q4 2022	Q4 2021**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	1.047,4	996,8	1.262,6	1.595,8	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	148,0	1.396,8	732,0	917,3	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.521,9	904,5	1.046,3	535,6	1.047,4	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	155,4	1.168,4	146,0	1.079,7	148,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	2.790,5	3.016,5	1.830,1	1.922,0	1.677,3	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.338,4	1.821,1	2.486,5	2.618,9	2.790,5	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	895,0	1.575,1	1.137,7	1.521,7	1.338,4	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	4.073,6	4.856,6	3.429,2	4.449,8	4.939,0	-
> 10 Jahre	587,8	1.598,9	307,4	1.334,8	617,4	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q4 2022		Q4 2021		Q4 2022	Q4 2021**
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	567,0	731,2	307,9	907,1	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	634,8	693,3	1.237,1	819,3	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	77,1	609,2	591,9	474,3	567,0	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	1.259,3	724,9	336,2	609,2	634,8	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.182,1	1.144,6	1.042,6	1.117,7	1.336,4	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.242,6	1.504,8	1.182,1	915,9	1.182,1	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.439,5	1.374,6	1.226,4	1.347,0	1.242,6	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	2.480,8	3.171,5	3.241,5	3.568,4	3.706,5	-
> 10 Jahre	1.258,6	2.510,4	1.646,1	2.391,5	1.472,4	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q4 2022	Q4 2021**
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.

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

4. Quartal 2022

Deckungswerte	Q4 2022 Mio. €	Q4 2021 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	2.592,8	2.786,8
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	1.160,5	947,4
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.737,8	2.724,2
Mehr als 10 Mio. €	10.029,8	8.775,4
Summe	16.520,9	15.233,9

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

4. Quartal 2022

Deckungswerte	Q4 2022 Mio. €	Q4 2021 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	2.864,9	2.977,9
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	3.399,4	3.176,3
Mehr als 100 Mio. €	6.200,2	5.996,4
Summe	12.464,5	12.150,6

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.

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		Wohnwirtschaftlich						Gewerblich								
		Mio. €	Mio. €	davon						Mio. €	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. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	16.520,9	7.173,6	1.070,8	1.875,9	4.213,8	0,4	12,7	9.347,3	5.406,6	1.942,8	1.032,5	909,5	47,6	8,4	-	-	
	Jahr 2021	15.233,9	6.569,3	1.059,4	1.753,8	3.743,0	0,6	12,5	8.664,5	4.680,8	2.116,1	975,5	877,4	7,8	6,9	-	-	
Deutschland	Jahr 2022	13.417,7	6.977,0	1.070,8	1.875,9	4.017,2	0,4	12,7	6.440,7	3.037,3	1.582,0	1.017,0	748,3	47,6	8,4	-	-	
	Jahr 2021	12.386,4	6.384,2	1.059,4	1.753,8	3.557,9	0,6	12,5	6.002,2	2.567,2	1.733,5	975,5	711,2	7,8	6,9	-	-	
Belgien	Jahr 2022	19,8	-	-	-	-	-	-	19,8	19,8	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2021	19,8	-	-	-	-	-	-	19,8	19,8	-	-	-	-	-	-	-	
Frankreich	Jahr 2022	197,8	-	-	-	-	-	-	197,8	189,6	-	8,2	-	-	-	-	-	
	Jahr 2021	124,0	-	-	-	-	-	-	124,0	124,0	-	-	-	-	-	-	-	
Großbritannien	Jahr 2022	1.007,2	-	-	-	-	-	-	1.007,2	909,6	6,4	-	91,1	-	-	-	-	
	Jahr 2021	898,3	-	-	-	-	-	-	898,3	795,3	6,8	-	96,2	-	-	-	-	
Niederlande	Jahr 2022	315,1	-	-	-	-	-	-	315,1	231,5	6,3	7,3	70,0	-	-	-	-	
	Jahr 2021	301,2	-	-	-	-	-	-	301,2	224,9	6,3	-	70,0	-	-	-	-	
Kanada	Jahr 2022	170,7	-	-	-	-	-	-	170,7	111,7	59,0	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2021	160,7	-	-	-	-	-	-	160,7	101,5	59,2	-	-	-	-	-	-	
USA	Jahr 2022	1.392,6	196,5	-	-	196,5	-	-	1.196,0	907,0	289,0	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2021	1.343,6	185,1	-	-	185,1	-	-	1.158,4	848,2	310,3	-	-	-	-	-	-	

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

4. 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	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	12.464,5	2.708,5	60,8	2.157,3	4.748,7	1.585,4	2.803,5	215,9	893,0	-
	Jahr 2021	12.150,6	1.927,4	70,8	2.408,7	4.833,1	1.571,3	1.977,6	167,8	1.121,5	-
Deutschland	Jahr 2022	11.613,6	2.082,8	-	2.087,9	4.748,7	1.585,4	2.082,8	215,9	893,0	-
	Jahr 2021	11.571,1	1.546,1	-	2.331,3	4.833,1	1.571,3	1.546,3	167,8	1.121,5	-
Belgien	Jahr 2022	32,8	32,8	-	-	-	-	32,8	-	-	-
	Jahr 2021	27,9	27,9	-	-	-	-	27,9	-	-	-
Dänemark	Jahr 2022	142,1	142,1	-	-	-	-	142,1	-	-	-
	Jahr 2021	88,7	88,7	-	-	-	-	88,7	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	69,4	69,4	-	-	-	-	69,4	-	-	-
	Jahr 2021	41,2	41,2	-	-	-	-	41,2	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	2,3	2,3	-	-	-	-	2,3	-	-	-
	Jahr 2021	2,7	2,7	-	-	-	-	2,7	-	-	-
Kroatien	Jahr 2022	20,0	-	20,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	68,8	68,8	-	-	-	-	68,8	-	-	-
	Jahr 2021	13,0	13,0	-	-	-	-	13,0	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	90,7	54,1	12,8	23,7	-	-	54,1	-	-	-
	Jahr 2021	100,1	59,9	12,8	27,4	-	-	59,9	-	-	-
Polen	Jahr 2022	18,0	-	18,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	38,0	-	38,0	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2022	87,0	87,0	-	-	-	-	87,0	-	-	-
	Jahr 2021	82,3	82,3	-	-	-	-	82,3	-	-	-
Slowenien	Jahr 2022	10,0	-	10,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	20,0	-	20,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	40,0	-	-	40,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	40,0	-	-	40,0	-	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	169,2	169,2	-	-	-	-	169,2	-	-	-
	Jahr 2021	65,5	65,5	-	-	-	-	65,5	-	-	-
USA	Jahr 2022	5,6	-	-	5,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	10,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	95,0	-	-	-	-	-	95,0	-	-	-
	Jahr 2021	50,0	-	-	-	-	-	50,0	-	-	-

* Die Position beinhaltet die Förderbanken in Höhe von 728 Mio. EUR für 2022 und in Höhe von 728 Mio. EUR für 2021.

**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

		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	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Dänemark	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Kroatien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarbriefe

4. Quartal 2022

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarbriefe 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		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		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2022	813,7	20,0	20,0	96,0	96,0	697,7	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2022	261,2	-	-	-	-	261,2	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Italien	Jahr 2022	32,0	-	-	-	-	32,0	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Kroatien	Jahr 2022	44,9	-	-	-	-	44,9	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Österreich	Jahr 2022	134,6	20,0	20,0	-	-	114,6	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Polen	Jahr 2022	45,0	-	-	-	-	45,0	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Schweden	Jahr 2022	96,0	-	-	96,0	96,0	-	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Slowenien	Jahr 2022	33,0	-	-	-	-	33,0	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Spanien	Jahr 2022	37,0	-	-	-	-	37,0	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
EU-Institutionen	Jahr 2022	130,0	-	-	-	-	130,0	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	

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

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	Mio. €	davon		davon		Mio. €	
			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		
Gesamtsumme alle Staaten	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2021	-	-	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	
	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. €)	12.558,0	12.377,7
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	64,2	59,7
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	17.334,6	15.975,7
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. €)	-	-
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	%	81,0	79,3
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	150,2	151,3
	CHF	23,2	25,2
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	915,4	897,4
	HKD	-	-
	JPY	0,1	0,5
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	733,9	720,1
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,6	5,8
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	55,4	55,3
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. €)	745,7	-
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. €)	10.141,8	10.812,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	70,0	58,6
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.464,5	12.150,6
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	%	74,4	78,4
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	6,5	1,1
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	183,9	107,9
	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. €)	31,7	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	17	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	1.384,8	-
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
4. Quartal 2022

Hypothekendarlehenpfandbriefe	
	Q4 2022
ISIN	DE000LBW6CA9, DE000LBW6CB7, DE000LBW6CC5, DE000LBW6CD3, DE000LBW6CE1, DE000LBW6CF8, DE000LBW6CG6, DE000LBW6CH4, DE000LBW6CJ0, DE000LBW6CK8, DE000LBW6CL6, DE000LBW6CM4, DE000LBW6CN2, DE000LBW6CP7, DE000LBW6CQ5, DE000LBW6CR3, DE000LBW6CS1, DE000LBW6CT9, DE000LBW6CU7, DE000LBW6CV5, DE000LBW6CW3, DE000LBW6CZ6, DE000LB0Q803, DE000LB0R082, DE000LB0SYX7, DE000LB0SZ17, DE000LB0UXK2, DE000LB0UX31, DE000LB0VF73, DE000LB0VPR1, DE000LB0VQ39, DE000LB0VQ54, DE000LB0V9T5, DE000LB0WA44, DE000LB0WA51, DE000LB0WA77, DE000LB0WW30, DE000LB0XYZ2, DE000LB0Z0X2, DE000LB00DG1, DE000LB00MU3, DE000LB01RPO, DE000LB01WS4, DE000LB06C06, DE000LB06FA6, DE000LB09PQ5, DE000LB1A706, DE000LB1B0U5, DE000LB1B0V3, DE000LB1B2S5, DE000LB1DRM4, DE000LB1DRN2, DE000LB1DRT9, DE000LB1DSM2, DE000LB1DSZ4, DE000LB1DVV5, DE000LB1DVX3, DE000LB1M2X2, DE000LB1P2E9, DE000LB1P6B6, DE000LB1P8N7, DE000LB1P8P2, DE000LB1P9C8, DE000LB125N3, DE000LB2CHJ1, DE000LB2CJQ2, DE000LB2CJR0, DE000LB2CJS8, DE000LB2CPG0, DE000LB2CQG8, DE000LB2CR05, DE000LB2CR21, DE000LB2CS87, DE000LB2CTZ2, DE000LB2CYY5, DE000LB2CYZ2, DE000LB2CY06, DE000LB2CY14, DE000LB2CY22, DE000LB2CY30, DE000LB2CY48, DE000LB2CY55, DE000LB2CY97, DE000LB2CZA2, DE000LB2CZB0, DE000LB2CZC8, DE000LB2CZD6, DE000LB2CZE4, DE000LB2C0B3, DE000LB2V502, DE000LB2V6L6, DE000LB2V6M4, DE000LB2WAB1, DE000LB2WAF2, DE000LB2ZSM3, DE000LB2ZS07, DE000LB2ZTL3, DE000LB2ZTR0, DE000LB2ZT55, DE000LB2ZT63, DE000LB2ZUX6, DE000LB2ZUY4, DE000LB2ZVN5, DE000LB2ZV93, DE000LB2ZWR4, DE000LB2ZWS2, DE000LB2ZWT0, DE000LB2ZX91, DE000LB38168, DE000LB382K6, DE000LB382L4, DE000LB383H0, DE000LB383J6, DE0002050572, DE0002050598, DE0002050622, DE0002050630, DE0002050655, DE0002050663, DE0002050671, DE0002050705, DE0002050721, DE0002060167, DE0002060175, DE0002060209, DE0002060217, DE0002060233, DE0002060241, DE0002820693, DE0003440350, DE0003440368, DE0003440392, DE0003440426, DE0003450417, DE0003450433, DE0003450474, DE0003450490, DE0003450532, DE0003450581, DE0003450615, DE0003450623, DE0003450631, DE0003450649, DE0003450656, DE0003450664, DE0003450672, DE0003450714, XF0002050478, XF0002820128, XF0002820201, XF0002820367, XF0003440157, XF0003440165, XF0003440199, XF0003440306, XF0003440462, XF0003450248, XF0003450263, XF0003450271, XF0003450693, XF0003450701

Öffentliche Pfandbriefe	
	Q4 2022
ISIN	DE000LBW0HZ8, DE000LBW3Q77, DE000LBW6PJ2, DE000LBW7JJ3, DE000LBW7YY1, DE000LB0BF02, DE000LB0R058, DE000LB00C85, DE000LB00DA4, DE000LB009J7, DE000LB01R04, DE000LB01WY2, DE000LB01WZ9, DE000LB06CF2, DE000LB1B1G2, DE000LB1B1S7, DE000LB1DQ71, DE000LB1DR96, DE000LB1D0B3, DE000LB1D064, DE000LB1D1B1, DE000LB1M0Z1, DE000LB1P2X9, DE000LB13AH8, DE000LB13A41, DE000LB2CKN7, DE000LB2CLB0, DE000LB2CMY0, DE000LB2CRR3, DE000LB2CRU7, DE000LB2CRZ6, DE000LB2CSN0, DE000LB2CSV3, DE000LB2CTH0, DE000LB2CYQ1, DE000LB2CYR9, DE000LB2CYS7, DE000LB2CYT5, DE000LB2CYU3, DE000LB2CYV1, DE000LB2WAH8, DE000LB2WAK2, DE000LB2WAL0, DE000LB2WAM8, DE000LB2WAN6, DE000LB2ZSL5, DE000LB2ZS31, DE000LB2ZVBO, DE000LB2ZVE4, DE000LB2ZXF7, DE000LB38077, DE000LB381U7, DE0002823911, DE0003413266, DE0003413308, DE0003443032, DE0003453106, DE0003453148, DE0003453197

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

Zahldifferenzen können rundungsbedingt auftreten.