

NORD/LB

Zum wahren Nutzen.



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 31. Dezember 2021

Inhalt

Angaben zu Hypothekenpfandbriefen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Pfandbriefen und deren Deckungswerten	16
Angaben zu Schiffspfandbriefen und deren Deckungswerten	26

Aufgrund von Rundungen können sich im vorliegenden Bericht bei Summenbildungen und bei der Berechnung von Prozentangaben geringfügige Abweichungen ergeben.

Gesamtbetrag der umlaufenden Hypothekendarlehen und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Pfandbriefumlauf	9.524,6	1.988,5	9.846,6	2.156,5	9.013,0	1.908,2	10.837,4	2.473,5	9.013,0	1.908,2
Deckungsmasse	12.259,9	5.133,4	13.291,8	5.591,0	12.135,6	5.176,5	14.808,8	6.229,2	12.074,1	5.175,4
Überdeckung	2.735,3	3.144,9	3.445,2	3.434,6	3.122,6	3.268,3	3.971,4	3.755,7	3.061,1	3.267,3
Überdeckung in %	28,7	158,2	35,0	159,3	34,6	171,3	36,6	151,8	34,0	171,2

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2021	Q4 / 2020
CHF	21,7	11,8
GBP	654,7	-

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q4 / 2021	-	30,0	-	264,6	294,6
	Q4 / 2020	-	46,9	-	25,0	71,9
Belgien	Q4 / 2021	-	-	-	10,5	10,5
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-
Italien	Q4 / 2021	-	-	-	15,0	15,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-
Japan	Q4 / 2021	-	-	-	149,0	149,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Luxemburg	Q4 / 2021	-	-	-	155,0	155,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-
Niederlande	Q4 / 2021	-	49,9	-	-	49,9
	Q4 / 2020	-	25,0	-	-	25,0
USA	Q4 / 2021	-	-	-	45,0	45,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-

Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Pfandbriefumlauf	9.524,6	1.988,5
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	97,52	87,35
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	12.259,9	5.133,4
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	79,05	76,64
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen des § 13 Abs. 1 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt der seit der Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit in Jahren	6,2	7,5
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q4 / 2021		Q4 / 2020	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	827,5	1.596,7	-	688,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	629,0	714,4	159,3	215,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.106,0	900,5	52,5	330,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	588,0	490,9	49,0	282,6
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.372,5	1.352,2	426,6	576,3
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	895,0	1.395,2	56,0	539,7
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.395,0	1.516,0	120,0	531,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.461,5	3.276,5	1.075,0	1.697,1
mehr als 10 Jahre	250,1	1.017,6	50,1	271,8
Gesamt	9.524,6	12.259,9	1.988,5	5.133,4

Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
bis zu 300 Tsd €	1.293,7	1.283,0
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	537,3	562,8
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	3.165,3	2.055,1
mehr als 10 Mio €	6.544,7	1.135,6
Gesamt	11.541,0	5.036,5

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					Gesamt
		Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familienhäuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und nicht ertrags- fähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q4 / 2021	261,3	849,8	2.377,5	-	-	3.488,6
	Q4 / 2020	248,9	833,5	2.486,8	-	1,9	3.571,2
Belgien	Q4 / 2021	-	-	7,5	-	-	7,5
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Q4 / 2021	4,1	13,2	191,3	-	-	208,6
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Q4 / 2021	-	-	26,7	-	-	26,7
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Irland	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					Gesamt
		Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familienhäuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und nicht ertrags- fähige Neubauten	Bauplätze	
Niederlande	Q4 / 2021	-	44,1	969,1	-	-	1.013,2
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q4 / 2021	-	-	24,6	-	-	24,6
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Polen	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Spanien	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q4 / 2021	265,4	907,1	3.596,6	-	-	4.769,1
	Q4 / 2020	248,9	833,5	2.486,8	-	1,9	3.571,2

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q4 / 2021	1.806,4	1.698,8	108,5	816,0	-	8,3	4.437,9
	Q4 / 2020	372,4	331,7	74,2	612,0	-	-	1.390,3
Belgien	Q4 / 2021	-	25,6	-	-	-	-	25,6
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Q4 / 2021	234,6	206,0	-	40,1	-	-	480,7
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Q4 / 2021	291,9	312,6	-	11,7	-	3,3	619,4
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Irland	Q4 / 2021	24,0	18,4	-	-	-	-	42,4
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Q4 / 2021	96,5	-	-	-	-	-	96,5
	Q4 / 2020	75,0	-	-	-	-	-	75,0

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Niederlande	Q4 / 2021	217,0	213,7	-	118,1	-	-	548,8
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q4 / 2021	80,2	7,9	-	-	-	-	88,1
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Q4 / 2021	157,1	182,6	-	22,5	-	-	362,2
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Q4 / 2021	16,7	47,2	-	6,3	-	-	70,2
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q4 / 2021	2.924,3	2.712,8	108,5	1.014,6	-	11,6	6.771,8
	Q4 / 2020	447,4	331,7	74,2	612,0	-	-	1.465,3

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Deutschland	Q4 / 2021	0,1	0,4
	Q4 / 2020	0,1	0,1
Belgien	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Frankreich	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Großbritannien	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Irland	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Luxemburg	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Niederlande	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Österreich	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Polen	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Spanien	Q4 / 2021	-	-
	Q4 / 2020	-	-
Gesamt	Q4 / 2021	0,1	0,4
	Q4 / 2020	0,1	0,1

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekenpfandbriefen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Pfandbriefen und deren Deckungswerten	16
Angaben zu Schiffspfandbriefen und deren Deckungswerten	26

Gesamtbetrag der umlaufenden Öffentlichen Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Pfandbriefumlauf	12.090,9	10.781,8	14.504,9	13.198,0	12.556,5	11.390,9	17.098,5	15.569,2	12.547,1	11.390,9
Deckungsmasse	15.303,0	14.407,3	17.941,6	17.122,8	15.593,3	14.866,2	21.304,1	20.386,2	15.518,5	14.838,4
Überdeckung	3.212,1	3.625,5	3.436,7	3.924,7	3.036,9	3.475,3	4.205,6	4.817,0	2.971,4	3.447,6
Überdeckung in %	26,6	33,6	23,7	29,7	24,2	30,5	24,6	30,9	23,7	30,3

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2021	Q4 / 2020
CHF	74,5	-
GBP	134,1	-
JPY	59,4	12,8
USD	219,8	153,9

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe gemäß § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Deutschland	Q4 / 2021	-	412,7	165,0	412,7
	Q4 / 2020	-	641,3	185,0	641,3
Niederlande	Q4 / 2021	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	75,0	-	75,0

Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Pfandbriefumlauf	12.090,9	10.781,8
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	96,94	96,37
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	15.303,0	14.407,3
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	86,99	89,37
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten	-	-

Laufzeitstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q4 / 2021		Q4 / 2020	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	457,8	1.067,0	1.324,8	956,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	517,7	763,4	369,0	775,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	569,8	689,1	205,1	902,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	432,1	552,1	269,5	639,1
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	991,8	1.564,1	778,4	1.227,8
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	533,6	1.219,8	896,9	1.301,1
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.734,1	1.940,4	366,6	1.116,8
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	4.620,2	3.760,7	4.514,2	4.263,6
mehr als 10 Jahre	2.233,8	3.746,2	2.057,4	3.223,7
Gesamt	12.090,9	15.303,0	10.781,8	14.407,3

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
bis zu 10 Mio €	2.745,8	2.852,8
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	5.431,7	5.279,3
mehr als 100 Mio €	6.712,7	5.558,9
Gesamt	14.890,3	13.691,0

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern (inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		
Deutschland	Q4 / 2021	11.594,4	55,0	3.738,1	5.170,5	2.630,8	1.652,0	314,4	550,3	617,9	169,5	(255,0)	13.246,4
	Q4 / 2020	11.600,3	45,0	3.096,7	6.068,1	2.390,5	1.485,0	312,0	413,8	584,5	174,7	(280,6)	13.085,3
Belgien	Q4 / 2021	200,0	-	75,0	-	125,0	85,5	-	-	-	85,5	(85,5)	285,5
	Q4 / 2020	10,0	-	-	-	10,0	50,8	-	-	-	50,8	(50,8)	60,8
Dänemark	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	68,3	-	-	-	68,3	(47,9)	68,3
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	71,7	-	-	-	71,7	(51,3)	71,7
Finnland	Q4 / 2021	13,0	-	-	8,0	5,0	-	-	-	-	-	(-)	13,0
	Q4 / 2020	5,0	-	-	-	5,0	-	-	-	-	-	(-)	5,0
Frankreich	Q4 / 2021	11,9	-	-	-	11,9	246,8	246,4	-	0,3	-	(61,4)	258,7
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	254,0	254,0	-	-	-	(63,5)	254,0
Großbritannien	Q4 / 2021	59,6	-	-	-	59,6	0,7	0,7	-	-	-	(0,7)	60,3
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	8,6	8,6	-	-	-	(8,6)	8,6
Italien	Q4 / 2021	30,5	23,6	7,0	-	-	-	-	-	-	-	(-)	30,5
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Japan	Q4 / 2021	10,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-	-	(-)	10,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Kanada	Q4 / 2021	44,5	-	14,1	-	30,4	-	-	-	-	-	(-)	44,5
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Lettland	Q4 / 2021	27,7	-	-	27,7	-	-	-	-	-	-	(-)	27,7
	Q4 / 2020	22,1	-	-	22,1	-	-	-	-	-	-	(-)	22,1

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern (inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		
Luxemburg	Q4 / 2021	128,6	-	-	-	128,6	-	-	-	-	-	(-)	128,6
	Q4 / 2020	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-	(-)	10,0
Niederlande	Q4 / 2021	21,1	21,1	-	-	-	29,9	29,9	-	-	-	(29,9)	51,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	34,1	34,1	-	-	-	(34,1)	34,1
Österreich	Q4 / 2021	236,3	230,7	-	5,6	-	8,6	8,6	-	-	-	(8,6)	244,9
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	12,8	12,8	-	-	-	(12,8)	12,8
Polen	Q4 / 2021	30,7	30,7	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	30,7
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Schweden	Q4 / 2021	8,0	-	-	8,0	-	-	-	-	-	-	(-)	8,0
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Schweiz	Q4 / 2021	72,4	-	72,4	-	-	11,3	-	-	-	11,3	(11,3)	83,7
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	12,5	-	-	-	12,5	(12,5)	12,5
Spanien	Q4 / 2021	16,2	-	-	-	16,2	-	-	-	-	-	(-)	16,2
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
USA	Q4 / 2021	75,0	-	75,0	-	-	207,3	137,5	-	-	69,8	(137,5)	282,3
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	281,5	198,5	-	-	83,0	(198,5)	281,5
Gesamt	Q4 / 2021	12.579,9	361,1	3.981,6	5.229,8	3.007,4	2.310,4	737,5	550,3	618,2	404,4	(637,7)	14.890,3
	Q4 / 2020	11.647,3	45,0	3.096,7	6.090,2	2.415,5	2.211,1	820,0	413,8	584,5	392,7	(712,8)	13.858,4

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Deutschland	Q4 / 2021	6,3	-	0,0	-	(6,3)	3,5	-	-	-	(3,5)
	Q4 / 2020	4,5	-	-	-	(4,5)	5,3	-	-	-	(5,3)
Belgien	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Dänemark	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Finnland	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Frankreich	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Großbritannien	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Italien	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Japan	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Kanada	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Lettland	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Luxemburg	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Niederlande	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Österreich	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Polen	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweden	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweiz	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Spanien	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
USA	Q4 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q4 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Gesamt	Q4 / 2021	6,3	-	0,0	-	(6,3)	3,5	-	-	-	(3,5)
	Q4 / 2020	4,5	-	-	-	(4,5)	5,3	-	-	-	(5,3)

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekenpfandbriefen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Pfandbriefen und deren Deckungswerten	16
Angaben zu Schiffspfandbriefen und deren Deckungswerten	26

Gesamtbetrag der umlaufenden Schiffspfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Pfandbriefumlauf	30,5	33,1	31,2	34,6	31,1	34,0	31,3	35,3	31,1	34,0
Deckungsmasse	40,0	40,0	40,7	41,3	38,6	38,5	44,2	46,2	38,6	38,5
Überdeckung	9,5	6,9	9,5	6,7	7,5	4,5	13,0	10,9	7,5	4,5
Überdeckung in %	31,1	20,8	30,5	19,4	24,2	13,3	41,4	30,8	24,2	13,3

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2021	Q4 / 2020
	-	-

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe gemäß § 26 Abs. 1 Nr. 2, Nr. 3 und Nr. 4 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2	Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q4 / 2021	-	-	-	40,0	40,0
	Q4 / 2020	-	-	-	40,0	40,0

Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Pfandbriefumlauf	30,5	33,1
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	67,21	69,79
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	40,0	40,0
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	57,50	57,50
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	30,4	-

Laufzeitstruktur der Schiffspfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q4 / 2021		Q4 / 2020	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	30,5	-	12,6	-
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	-	-	-	-
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	-	-	20,5	-
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	-	-	-	-
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	-	10,0	-	-
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	-	20,0	-	10,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	-	-	-	20,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	-	10,0	-	10,0
mehr als 10 Jahre	-	-	-	-
Gesamt	30,5	40,0	33,1	40,0

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
bis zu 500 Tsd €	-	-
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	-	-
mehr als 5 Mio €	-	-
Gesamt	-	-

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach See- und Binnenschiffen

in Mio €		Seeschiffe						Binnenschiffe	Gesamt
		Gesamt	davon						
			Bulker	Containerschiff	Mehrzweckfrachter	Tanker	Sonstige		
Deutschland	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q4 / 2021	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q4 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q4 / 2021	Q4 / 2020
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	-	-