

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

## Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

### 1. Quartal 2023

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022
<b>Hypothekendarfandbriefe</b>	(Mio. €)	9.387,7	9.387,1	8.850,2	9.399,3	8.158,4	8.668,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	12.727,9	11.951,6	12.393,4	12.508,0	11.350,9	11.391,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	3.340,3	2.564,5	3.543,3	3.108,7	3.192,5	2.722,7
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		35,6	27,3	40,0	33,1	39,1	31,4
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	384,8	-	177,0	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	2.955,5	-	3.366,3	-	-	-
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*	
		Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	11.851,1	12.037,0	11.852,0	13.603,8	10.402,7	11.802,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	13.975,2	14.924,7	13.917,1	16.583,9	12.130,0	14.420,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	2.124,1	2.887,7	2.065,1	2.980,1	1.727,3	2.618,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,9	24,0	17,4	21,9	16,6	22,2
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	461,2	-	237,0	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	1.662,9	-	1.828,2	-	-	-
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*	
		Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022	Q1 2023	Q1 2022
<b>Schiffspfandbriefe</b>	(Mio. €)	-	10,5	-	10,5	-	10,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	-	40,0	-	39,9	-	38,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	(Mio. €)	-	29,5	-	29,4	-	27,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	281,0	-	280,0	-	262,9
Gesetzliche Überdeckung**, 1	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Vertragliche Überdeckung**, 2	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung**, 3	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	-	-	-	-	-

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

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

<sup>1</sup> 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

<sup>2</sup> Vertraglich zugesicherte Überdeckung

<sup>3</sup> 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**  
**1. Quartal 2023**

Hypothekendarlehen	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023 F&V (12 Monate)*	Q1 2022** F&V (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €		
<b>Restlaufzeit:</b>						
<= 0,5 Jahre	368,1	1.389,0	1.340,0	1.408,6	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	661,0	1.074,2	799,0	915,1	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	772,0	648,9	368,0	609,0	368,1	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	525,5	768,8	661,0	669,9	661,0	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.910,0	2.019,4	1.297,5	1.257,3	1.297,5	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.800,0	1.312,4	910,0	1.772,9	1.910,0	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.516,5	1.480,2	1.800,0	1.256,6	1.800,0	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.620,1	3.238,3	1.981,6	3.120,7	2.981,6	-
> 10 Jahre	214,5	796,7	230,0	941,5	369,5	-

  

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023 F&V (12 Monate)*	Q1 2022** F&V (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €		
<b>Restlaufzeit:</b>						
<= 0,5 Jahre	480,1	898,8	318,9	966,1	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	560,9	838,0	680,4	813,5	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	164,0	715,0	424,2	538,0	480,1	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	1.147,0	536,0	441,6	694,9	560,9	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	793,4	1.036,6	1.025,5	1.578,3	1.311,0	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	2.141,4	1.569,6	834,4	1.191,5	793,4	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	463,0	1.091,9	2.183,7	1.964,8	2.141,4	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.181,8	3.201,1	3.801,4	3.515,4	3.368,1	-
> 10 Jahre	2.919,5	4.088,2	2.326,8	3.662,2	3.196,1	-

  

Schiffspfandbriefe	Q1 2023		Q1 2022		Q1 2023 F&V (12 Monate)*	Q1 2022** F&V (12 Monate)*
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €		
<b>Restlaufzeit:</b>						
<= 0,5 Jahre	-	-	10,5	-	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	-	-	-	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	-	-	-	-	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	-	-	10,0	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	-	-	20,0	-	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	-	-	-	-	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	-	-	10,0	-	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	-	-	-	-	-
> 10 Jahre	-	-	-	-	-	-

**Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe**

	Q1 2023	Q1 2022**
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 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.	
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.	

\* 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 könnten.

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

**Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen**

**1. Quartal 2023**

Deckungswerte	Q1 2023 Mio. €	Q1 2022 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	1.257,7	1.270,5
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	520,7	506,3
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.947,3	3.035,1
Mehr als 10 Mio. €	7.402,1	6.345,6
<b>Summe</b>	<b>12.127,8</b>	<b>11.157,5</b>

**Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen**

**1. Quartal 2023**

Deckungswerte	Q1 2023 Mio. €	Q1 2022 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	2.697,8	2.679,7
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	5.832,1	5.298,1
Mehr als 100 Mio. €	4.994,1	6.544,6
<b>Summe</b>	<b>13.524,0</b>	<b>14.522,4</b>

**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.**

**1. 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	1. Quartal	Insgesamt		davon						Gewerblich								
		Mio. €	Mio. €	Wohnwirtschaftlich						Mio. €	davon							
				Insgesamt	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Mio. €	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. €			
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	12.127,6	4.672,7	262,3	877,1	3.509,7	-	23,6	7.455,0	3.369,8	2.695,0	101,6	1.098,4	98,9	91,2	0,6	0,1	
	Jahr 2022	11.157,4	4.675,7	258,5	893,8	3.510,5	12,9	-	6.481,7	2.575,5	2.607,0	111,9	997,9	107,9	81,5	0,1	0,9	
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	8.033,6	3.286,9	258,2	832,3	2.172,8	-	23,6	4.746,7	2.045,2	1.630,7	101,6	803,2	77,9	88,1	0,0	0,1	
	Jahr 2022	7.745,7	3.423,1	254,4	837,0	2.331,7	-	-	4.322,6	1.548,7	1.699,3	111,9	816,9	67,5	78,3	0,1	0,9	
<b>Belgien</b>	Jahr 2023	33,0	7,5	-	-	7,5	-	-	25,5	-	25,5	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2022	33,1	7,5	-	-	7,5	-	-	25,6	-	25,6	-	-	-	-	-	-	
<b>Frankreich</b>	Jahr 2023	727,9	195,5	4,1	13,3	178,1	-	-	532,4	259,3	194,4	-	57,8	20,9	-	-	-	
	Jahr 2022	645,4	208,1	4,1	13,0	191,0	-	-	437,3	190,5	192,7	-	40,1	14,0	-	-	-	
<b>Großbritannien</b>	Jahr 2023	740,9	54,7	-	-	54,7	-	-	686,2	314,4	357,5	-	11,1	-	3,1	0,6	-	
	Jahr 2022	576,9	-	-	-	-	-	-	576,9	275,0	260,7	-	11,6	26,4	3,2	-	-	
<b>Irland</b>	Jahr 2023	146,9	-	-	-	-	-	-	146,9	59,1	33,9	-	53,9	-	-	-	-	
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2023	183,7	-	-	-	-	-	-	183,7	183,7	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2022	96,5	-	-	-	-	-	-	96,5	96,5	-	-	-	-	-	-	-	
<b>Niederlande</b>	Jahr 2023	1.646,0	1.103,5	-	31,5	1.072,0	-	-	542,5	233,6	159,0	-	149,9	-	-	-	-	
	Jahr 2022	1.542,9	1.012,4	-	43,8	955,7	12,9	-	530,5	216,8	212,7	-	101,0	-	-	-	-	
<b>Österreich</b>	Jahr 2023	111,5	24,6	-	-	24,6	-	-	86,9	80,2	6,7	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2022	112,1	24,6	-	-	24,6	-	-	87,5	80,2	7,3	-	-	-	-	-	-	
<b>Polen</b>	Jahr 2023	416,1	-	-	-	-	-	-	416,1	153,4	240,2	-	22,5	-	-	-	-	
	Jahr 2022	292,7	-	-	-	-	-	-	292,7	127,1	143,1	-	22,5	-	-	-	-	
<b>Spanien</b>	Jahr 2023	88,1	-	-	-	-	-	-	88,1	40,9	47,2	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2022	69,7	-	-	-	-	-	-	69,7	16,7	47,2	-	5,8	-	-	-	-	
<b>übrige Staaten/Institutionen</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2022	42,4	-	-	-	-	-	-	42,4	24,0	18,4	-	-	-	-	-	-	

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen**

**1. Quartal 2023**

<b>Deckungswerte</b>											
Staat	1. Quartal	Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		Mio. €	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
			in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung								
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	13.555,5	339,9	491,7	2.702,8	5.686,9	2.773,7	375,6	602,5	675,4	247,0
	Jahr 2022	14.522,2	463,6	338,8	3.903,9	5.276,8	2.918,9	610,9	509,3	589,2	374,4
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	12.020,7	187,2	10,0	2.454,3	5.646,5	2.409,0	281,5	588,1	531,0	100,3
	Jahr 2022	12.957,6	129,2	55,0	3.648,6	5.218,7	2.542,2	224,2	509,3	589,0	170,6
<b>Belgien</b>	Jahr 2023	243,9	43,9	-	75,0	-	125,0	-	-	-	43,9
	Jahr 2022	258,3	58,3	-	75,0	-	125,0	-	-	-	58,3
<b>Dänemark</b>	Jahr 2023	43,6	43,6	-	-	-	-	-	-	-	43,6
	Jahr 2022	68,7	48,3	-	-	-	-	-	-	-	68,7
<b>Finnland</b>	Jahr 2023	12,2	-	-	-	7,2	5,0	-	-	-	-
	Jahr 2022	13,0	-	-	-	8,0	5,0	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2023	208,5	-	-	-	-	11,4	38,4	14,4	144,4	-
	Jahr 2022	242,5	60,0	-	-	-	11,8	230,5	-	0,2	-
<b>Großbritannien</b>	Jahr 2023	56,9	-	-	-	-	56,9	-	-	-	-
	Jahr 2022	59,1	-	-	-	-	59,1	-	-	-	-
<b>Italien</b>	Jahr 2023	29,9	-	24,9	5,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	30,0	-	23,7	6,3	-	-	-	-	-	-
<b>Lettland</b>	Jahr 2023	21,2	-	-	-	21,2	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	26,5	-	-	-	26,5	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2023	103,2	-	-	-	-	103,2	-	-	-	-
	Jahr 2022	128,6	-	-	-	-	128,6	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	Jahr 2023	23,5	23,5	-	-	-	-	23,5	-	-	-
	Jahr 2022	27,7	27,7	-	-	-	-	27,7	-	-	-
<b>Österreich</b>	Jahr 2023	436,3	3,2	429,1	-	4,0	-	3,2	-	-	-
	Jahr 2022	242,5	6,4	230,5	-	5,6	-	6,4	-	-	-
<b>Polen</b>	Jahr 2023	27,6	-	27,6	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	29,6	-	29,6	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	Jahr 2023	8,0	-	-	-	8,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	8,0	-	-	-	8,0	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2022	16,2	-	-	-	-	16,2	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	Jahr 2023	69,7	9,5	-	60,2	-	-	-	-	-	9,5
	Jahr 2022	84,6	11,6	-	73,0	-	-	-	-	-	11,6
<b>Japan</b>	Jahr 2023	41,7	-	-	10,0	-	31,7	-	-	-	-
	Jahr 2022	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	Jahr 2023	46,4	-	-	14,7	-	31,7	-	-	-	-
	Jahr 2022	45,4	-	-	14,4	-	31,0	-	-	-	-
<b>USA</b>	Jahr 2023	162,3	29,1	-	83,6	-	-	29,1	-	-	49,7
	Jahr 2022	273,9	122,1	-	86,6	-	-	122,1	-	-	65,2

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

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
Staat	1. Quartal	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
	Jahr 2023	8,3	8,3	-	-	-	0,9	0,9	-	-	-
	Jahr 2022	6,2	6,2	-	-	-	2,6	2,6	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	8,3	8,3	-	-	-	0,9	0,9	-	-	-
	Jahr 2022	6,2	6,2	-	-	-	2,6	2,6	-	-	-

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarstellungen**  
**1. Quartal 2023**

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarstellungen 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	1. Quartal	Summe				
		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)	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	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	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. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	600,1	384,1	-	-	216,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	379,6	334,6	-	-	45,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	Jahr 2023	7,0	-	-	-	7,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	Jahr 2023	15,0	-	-	-	15,0
	Jahr 2022	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	Jahr 2023	49,6	49,6	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	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**  
**1. 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	1. Quartal	Summe	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	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	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. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2023	451,2	451,2	115,0	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2023	451,2	451,2	115,0	-	-	-	-
	Jahr 2022	-	-	-	-	-	-	-

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



**Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten**

**1. Quartal 2023**

<b>Hypothekendarlehen</b>		<b>Q1 2023</b>	<b>Q1 2022</b>
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>			
(Mio. €)		9.387,7	9.387,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	97,8	97,8
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
<b>Deckungsmasse</b>			
(Mio. €)		12.727,9	11.951,6
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. €)	22,4	-
§ 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	%	77,7	80,7
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro	CAD	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CHF	21,2	10,7
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	744,8	574,3
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)	Jahre	5,9	6,3
§ 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)	%	-	-
<b>Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*</b>			
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. €)	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG</b>			
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)	%	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG</b>			
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**

**1. Quartal 2023**

<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>		<b>Q1 2023</b>	<b>Q1 2022</b>
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	11.851,1	12.037,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	97,9	96,9
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	13.975,2	14.924,7
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen 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*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%	88,5	88,6
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	-	-
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	60,1	75,0
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	105,8	126,7
	HKD	-	-
	JPY	39,8	29,3
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	200,9	221,6
	AUD	-	-
<b>Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*</b>			
Größe sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	95,1	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	48	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG</b>			
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)	%	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG</b>			
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.

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

### 1. Quartal 2023

Schiffspfandbriefe		Q1 2023	Q1 2022
<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	-	10,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	-	4,8
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
<b>Deckungsmasse</b>	(Mio. €)	-	40,0
davon Gesamtbetrag der Schiffshypotheken nach § 21, die die Grenzen nach § 22 Abs. 5 S. 2 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 26 Abs. 1, die die Grenzen nach § 26 Abs. 1 S. 6 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 5 überschreiten*	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%	-	57,5
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	-	-
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
<b>Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG*</b>			
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. €)	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG</b>			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 4 (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 4 (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG</b>			
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  
1. Quartal 2023**

<b>Hypothekendarlehenpfandbriefe</b>		
	<b>Q1 2023</b>	<b>Q1 2022*</b>
ISIN	DE000BRL0385, DE000BRL0419, DE000BRL0435, DE000DHY4002, DE000DHY4648, DE000DHY4861, DE000DHY4887, DE000DHY4945, DE000DHY4952, DE000DHY4960, DE000DHY4986, DE000DHY4994, DE000DHY5025, DE000DHY5074, DE000NLB0PB3, DE000NLB2TD7, DE000NLB3UX1, DE000NLB3ZY8, DE000NLB3ZZ5, DE000NLB3Z75, DE000NLB34Y2, DE000NLB4RJ4,	-

<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>		
	<b>Q1 2023</b>	<b>Q1 2022*</b>
ISIN	DE000BRL3157, DE000BRL3256, DE000BRL3264, DE000BRL3280, DE000BRL3298, DE000NLB1LD6, DE000NLB1VT1, DE000NLB2JX6, DE000NLB2Q36, DE000NLB34V8, DE000NLB34X4, DE000NLB8CC2, DE000NLB8EY2, DE000NLB8E83, DE000NLB85X6, DE000NLB8739,	-

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