

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 11, 12, und 13 PfandBG sowie § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6, 7 und 15 PfandBG

Kennzahlen zu öffentlichen Pfandbriefen und dafür verwendeter Deckungswerte

		Q3 2022	Q3 2021
		Mio. €	Mio. €
Umlaufende öffentliche Pfandbriefe		9.717,5	10.537,7
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13		71,0%	72,3%
Deckungsmasse		10.708,3	11.665,0
davon Gesamtbetrag der Forderung nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 11)		-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*		-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 3 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*		-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13		73,1%	70,5%
	CAD	15,1	12,6
Nettobarwert nach § 6 Abs. 1 Pfandbrief-	CHF	56,7	68,8
Barwertverordnung je Fremdwährung in Euro	GBP	233,7	169,3
§ 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	JPY	207,6	202,6
	USD	314,7	537,9

Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6*

	Q3 2022	Q3 2021
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a Satz 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio €) 2,8	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180) 70	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a Satz 3 erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio €) 329,0	-

Kennzahlen zu Derivaten nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 7

	Q3 2022	Q3 2021
	in %	
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 (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 Satz 1 Nr. 15

	Q3 2022	Q3 2021
	in %	
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%	0,0%