

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €)

§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 1, Nr. 3

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>	Überdeckung	Gesetzliche Überdeckung <sup>(2)</sup>	Vertragliche Überdeckung <sup>(3)</sup>	Freiwillige Überdeckung <sup>(4)</sup>
Nennwert	1.349,0	1.204,4	144,6	48,3	-	96,3
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
Barwert	1.483,0	1.301,6	181,4	26,0	-	155,4
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
Risikobarwert <sup>(5)</sup>	1.322,3	1.206,9	115,4	-	-	-

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(1)</sup>	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.478,4	1.393,7	84,7
davon Derivate	-	-	-
Barwert	2.017,7	1.761,5	256,2
davon Derivate	58,7	-	-
Risikobarwert <sup>(5)</sup>	1.871,8	1.675,4	196,2

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €) nach vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>	Überdeckung
Nennwert	1.349,0	1.204,4	144,6
Barwert	1.483,0	1.301,6	181,4

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(1)</sup>	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.478,4	1.393,7	84,7
Barwert	2.017,7	1.761,5	256,2

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio.€)

§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 4, Nr. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>	Pfandbriefe im Umlauf FZV (12 Monate) <sup>(2)(3)</sup>
bis zu 6 Monate	112,3	96,8	-
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	15,4	89,1	-
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	115,5	19,0	96,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	18,2	78,5	89,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	26,2	255,7	97,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	80,2	114,5	255,8
mehr als 4 bis 5 Jahre	29,7	196,8	114,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	180,9	146,4	318,8
mehr als 10 Jahre	770,8	207,6	231,9
Total	1.349,0	1.204,4	1.204,4

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(1)</sup>
bis zu 6 Monate	34,7	27,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	122,4	114,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	157,5	94,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	15,2	89,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	154,9	95,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	25,5	253,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	79,7	114,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	197,3	318,8
mehr als 10 Jahre	691,2	286,8
Total	1.478,4	1.393,7

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio.€)

§28 Abs. 3 Nr. 1

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	127,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	480,3
mehr als 100 Mio. €	761,5
Total	1.349,0

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	158,3
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	414,7
mehr als 100 Mio. €	907,4
Total	1.478,4

Verteilung der nennwertig als Deckung für Öffentliche Pfandbriefe verwendeten Forderungen auf die einzelnen Staaten, in denen der Schuldner bzw. die gewährleistende Stelle ihren Sitz hat - aufgeschlüsselt nach §28 Abs. 3 Nr. 2 (Mio. €)

§28 Abs. 3 Nr. 2

Länder	Gesamt	in der Summe erfüllbare Gewährleistungen aus Objekten der Eigentümergebietung	Staat	davon geschuldet von Gebietskörperschaft			Sonstige	Staat	davon gewährleistet von Gebietskörperschaft		
				regionale	örtliche	regionale			örtliche	Sonstige	
Deutschland	1.034,0	-	-	775,3	216,0	22,0	0,1	0,7	19,9	-	
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-	
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-	
Spanien	20,0	-	-	20,0	-	-	-	-	-	-	
Total	1.349,0	-	200,0	820,3	236,0	22,0	50,1	0,7	19,9	-	

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Länder	Gesamt	in der Summe erfüllbare Gewährleistungen aus Objekten der Eigentümergebietung	Staat	davon geschuldet von Gebietskörperschaft			Sonstige	Staat	davon gewährleistet von Gebietskörperschaft		
				regionale	örtliche	regionale			örtliche	Sonstige	
Deutschland	1.162,4	-	-	854,9	256,3	17,9	0,1	1,0	22,2	-	
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-	
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-	
Spanien	31,0	-	-	31,0	-	-	-	-	-	-	
Total	1.478,4	-	200,0	910,9	276,3	17,9	50,1	1,0	22,2	-	

Weitere Deckungswerte gemäß §28 Abs. 1 S. 1 Nr. 8, Nr. 9 - Detaildarstellung (Mio. €)

§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 8, Nr. 9

Staaten	Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2		Gesamt
	Insgesamt	deren gesetzliche Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Konvention (Art. Nr. 37/2013)	Insgesamt	deren gesetzliche Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Konvention (Art. Nr. 37/2013)	Insgesamt	deren gesetzliche Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Konvention (Art. Nr. 37/2013)	
Total	-	-	-	-	-	-	-

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 1	Geldforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
		Insgesamt	deren gesetzliche Schuldverschreibungen i.S.v. Art. 129 der Konvention (Art. Nr. 37/2013)	
Total	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe <sup>(1)</sup>	1.204,4	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	97,9	%	§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 13
<b>Deckungsmasse</b>	1.349,0	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten <sup>(2)</sup>	-	Mio. €	§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 Nr. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 Nr. 3 liegt <sup>(3)</sup>	-	Mio. €	§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,1	%	§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 13
davon Anteil, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetretet gilt <sup>(4)</sup>	-	%	§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15
<b>Nettoanwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung</b>			§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 14
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite		
EUR	115,4	Mio. €	
<b>Kennzahlen zur Liquidität<sup>(5)</sup></b>			§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6
Größe sich innerh. der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe i.S. des § 4 Abs. 1a S. 3 (Liquiditätsbedarf)	-0,3	Mio. €	
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	2	Tag (1-180)	
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 erfüllen (Liquiditätsdeckung)	102,7	Mio. €	
<b>Kennzahlen Derivate<sup>(6)</sup></b>			§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7
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 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 c (Bonitätsstufe 1)	-	%	

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Umlaufende Pfandbriefe <sup>(7)</sup>	1.393,7	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	84,0	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	1.478,4	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	91,6	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Nettoanwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung</b>			§28 Abs. 1 Nr. 10
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite		
EUR	196,2	Mio. €	

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe<sup>(8)</sup>

§28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6

Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Das Hinschieben 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.
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Der Sachwaller 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 Sachwaller entsprechend der Erforderlichkeit. Der Sachwaller kann die Fälligkeiten von Tilgungs- und Zinszahlungen, die innerhalb eines Monats nach seiner Ernennung fällig werden, auf das Ende dieses Monatszeitraums verschieben. Entschieden sich der Sachwaller für eine solche Verschiebung, wird das Vorliegen der Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG unwiderruflich vermutet. Eine solche Verschiebung ist im Rahmen der Höchstverschiebungsdauer von 12 Monaten zu berücksichtigen. Der Sachwaller darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe einer Emission nur einheitlich Gebrauch machen. Hierbei dürfen die Fälligkeiten vollständig oder anteilig verschoben werden. Der Sachwaller hat die Fälligkeit für eine Pfandbriefemission so zu verschieben, dass die ursprüngliche Reihenfolge der Bedienung der Pfandbriefe, welche durch die Verschiebung überholt werden können, nicht geändert wird (Überholverbot). Dies kann dazu führen, dass auch die Fälligkeiten später fälliger Emissionen zu verschieben sind, um das Überholverbot zu wahren. Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2a und 2b PfandBG.

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.

(1) - Davon in den Eigenbestand übernommen: - Mio. €

(2) - Davon in den Eigenbestand übernommen: - Mio. €

(3) - dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

(4) - Gesetzliche Überdeckung nach dem Nominalwert: Summe aus der nennwertigen sicheren Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG und des Nennwerts der barwertigen sicheren Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG  
Barwert: Barwertige sichere Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG

- Vertragliche Überdeckung: Vertraglich zugesicherte Überdeckung

- Freiwillige Überdeckung: Residual, in Abhängigkeit der gesetzlichen und vertraglichen Überdeckung; Barwert enthält den Barwert der nennwertigen sicheren Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG

(5) - 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.

(6) - Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.