

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG Öffentliche Pfandbriefe

3. Quartal 2022
Stichtag: 30.09.2022

The Deka logo is displayed in white text on a red, wavy background. It consists of a stylized double-dot symbol followed by the word "Deka" in a bold, sans-serif font.



Inhaltsverzeichnis

Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG

	Seite(n)
I. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerte	3
II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	3
III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse	3
IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten	4
V. Laufzeitstruktur	5
VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen	6
VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe	6
VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte	7
IX. Überschreitungen	8
X. Aufteilung der Deckungsmasse - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	9
XI. Aufteilung der Deckungsmasse (direkt geschuldet) - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	10
XII. Aufteilung der Deckungsmasse (gewährleistet) - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	11
XIII. Aufteilung der Deckungsmasse (Exportkreditförderung) - Ordentliche Deckung in Mio. EUR	12
XIV. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)	13
XV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)	14
XVI. Kennzahlen zur Liquidität	15
XVII. Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung nach § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG	16

Zusätzliche freiwillige Angaben

I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse	17-18
II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf	19



I. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerte

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q3/2022	Q3/2021**	Q3/2022	Q3/2021**
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	4.055,3	3.666,4	3.731,3	3.829,2
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.574,5	4.370,4	4.180,5	4.592,9
Überdeckung	519,2	704,0	449,2	763,7
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	12,8 %	19,2 %	12,0 %	19,9 %
Gesetzliche Überdeckung **	164,9		157,3	
Vertragliche Überdeckung	-		-	
Freiwillige Überdeckung	354,3		291,9	

** Das gesetzliche Überdeckungserfordernis setzt sich aus der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG inkl. Zins- und Währungsstressszenarien und der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG zusammen. Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Überdeckung nach dem vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	519,2	704,0	449,2	763,7
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	12,8 %	19,2 %	12,0 %	19,9 %

III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert	
	Q3/2022	Q3/2021
Derivate	0,0	0,0



IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Risikobarwert + 250 BP		Risikobarwert - 250 BP		Risikobarwert Währungsstress	
	Q3/2022	Q3/2021**	Q3/2022	Q3/2021**	Q3/2022	Q3/2021**
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	3.370,7	3.421,4	4.169,9	4.336,3	3.362,9	3.421,4
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	3.760,9	4.055,2	4.731,5	5.330,0	3.742,5	4.035,9
Überdeckung	390,2	633,7	561,6	993,7	379,6	614,4
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	11,6 %	18,5 %	13,5 %	22,9 %	11,3 %	18,0 %
Gesetzliche Überdeckung **	133,6		167,5		133,1	
Vertragliche Überdeckung	-		-		-	
Freiwillige Überdeckung	256,6		394,1		246,5	

** Das gesetzliche Überdeckungserfordernis setzt sich aus der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG inkl. Zins- und Währungsstressszenarien und der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG zusammen. Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

Fremdwährungen	Nettobarwert in Fremdwährung (in Mio.)		Wechselkurs		Nettobarwert in Mio. EUR	
	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
USD	114,7	134,1	0,97480	1,15790	117,6	115,8
Gesamtsumme					117,6	115,8

Hinweis: Die Ermittlung des Risikobarwertes erfolgt nach Maßgabe des statischen Ansatzes gemäß PfandBarwertV



V. Laufzeitstruktur

Laufzeitbänder	Pfandbriefumlauf in Mio. EUR		Deckungsmasse in Mio. EUR		Pfandbriefumlauf bei Fälligkeitsverschiebung von 12 Monate* in Mio. EUR	Pfandbriefumlauf bei Fälligkeitsverschiebung von 12 Monate* in Mio. EUR
	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021**
<= 6 Monate	420,0	393,0	223,9	16,4	0,0	
6 Monate <= 12 Monate	290,0	30,0	126,6	70,4	0,0	
12 Monate <= 18 Monate	265,0	420,0	349,8	158,3	420,0	
18 Monate <= 2 Jahre	137,5	290,0	180,6	131,0	290,0	
2 Jahre <= 3 Jahre	563,0	349,9	229,7	556,7	402,5	
3 Jahre <= 4 Jahre	327,8	562,0	271,9	275,6	563,0	
4 Jahre <= 5 Jahre	510,0	324,0	489,7	327,9	327,8	
5 Jahre <= 10 Jahre	1.245,5	901,9	1.200,7	1.501,9	1.405,5	
> 10 Jahre	296,6	395,6	1.501,7	1.332,3	646,6	
Gesamtsumme	4.055,3	3.666,4	4.574,5	4.370,4	4.055,3	

* Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

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

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe:

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 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.

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.

Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

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.



VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen

Gesamtnennwert der Deckungsmasse nach Größenklassen (in Mio. EUR)			Q3/2022	Q3/2021
Ordentliche Deckung	<=	10 Mio. EUR	144,1	141,9
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG				
Ordentliche Deckung	10 Mio. EUR <=	100 Mio. EUR	2.723,7	2.173,6
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG				
Ordentliche Deckung	>	100 Mio. EUR	1.677,5	2.055,0
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG				
Summe			4.545,3	4.370,4
Weitere Deckungswerte gem. § 20 Abs. 2 und Werte der barwertigen sichernden Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 S. 3 PfandBG			29,2	0,0
Gesamtsumme			4.574,5	4.370,4

VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe

Verhältnis der Gesamtsummen zu den Anteilen festverzinslicher Positionen	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Nennwert an festverzinslichen Positionen		davon: Prozentualer Anteil an festverzinslichen Positionen	
	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
	Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	4.055,3	3.666,4	4.055,3	3.666,4	100,0 %
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	4.574,5	4.370,4	3.739,7	3.412,6	81,8 %	78,1 %



VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte

Gesamtbetrag der weiteren Deckungswerte gem. § 20 Abs. 2 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2022	Q3/2021
	29,2	0,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 Nr. 8 in Verbindung mit § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 PfandBG	Code (*)	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013		
		Sitzland der Schuldner	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Gesamtsumme			0,0	0,0	0,0	0,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S.1 Nr. 9 in Verbindung mit § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis c) PfandBG	Code (*)	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013		
		Sitzland der Schuldner	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Gesamtsumme			0,0	0,0	0,0	0,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S.1 Nr. 9 in Verbindung mit § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4 PfandBG	Code (*)	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013		
		Sitzland der Schuldner	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE		29,2	0,0	0,0	0,0
Gesamtsumme			29,2	0,0	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



IX. Überschreitungen

Angaben zu § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11 und 12 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2022	Q3/2021
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG überschreiten	0,0	0,0
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG überschreiten	0,0	0,0
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 3 PfandBG überschreiten	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



X. Aufteilung der Deckungsmasse Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen		Staat		Regionale Gebiets- körperschaft		Örtliche Gebiets- körperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme		davon: Gewährleis- tungen aus Export- kreditförderung	
Land	Code (*)	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	44,0	114,1	497,2	534,4	2.642,6	2.449,7	782,7	608,5	3.966,5	3.706,7	44,0	114,1
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	103,8	106,3	103,8	106,3	103,8	106,3
Kanada	CA	0,0	0,0	25,2	21,2	0,0	0,0	0,0	0,0	25,2	21,2	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	73,9	91,8	0,0	0,0	73,9	91,8	0,0	0,0
Niederlande	NL	112,5	133,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	112,5	133,3	112,5	133,3
Norwegen	NO	25,0	37,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	25,0	37,5	25,0	37,5
Vereinigte Staaten von Amerika	US	55,8	67,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	55,8	67,2	55,8	67,2
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	182,5	206,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	182,5	206,4	182,5	206,4
Summe		419,8	558,5	522,4	555,6	2.716,5	2.541,5	886,5	714,8	4.545,3	4.370,4	523,7	664,8

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**XI. Aufteilung der Deckungsmasse (direkt geschuldet)
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der Schuldner	Code (*)	Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme	
		Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	497,2	534,4	2.642,6	2.449,7	782,7	608,5	3.922,5	3.592,6
Kanada	CA	0,0	0,0	14,9	12,6	0,0	0,0	0,0	0,0	14,9	12,6
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	73,9	91,8	0,0	0,0	73,9	91,8
Summe		0,0	0,0	512,1	547,0	2.716,5	2.541,5	782,7	608,5	4.011,3	3.697,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**XII. Aufteilung der Deckungsmasse (gewährleistet)
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der gewährleistenden Stellen		Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme	
Land	Code (*)	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	44,0	114,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	44,0	114,1
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	103,8	106,3	103,8	106,3
Kanada	CA	0,0	0,0	10,3	8,6	0,0	0,0	0,0	0,0	10,3	8,6
Niederlande	NL	112,5	133,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	112,5	133,3
Norwegen	NO	25,0	37,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	25,0	37,5
Vereinigte Staaten von Amerika	US	55,8	67,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	55,8	67,2
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	182,5	206,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	182,5	206,4
Summe		419,8	558,5	10,3	8,6	0,0	0,0	103,8	106,3	533,9	673,5

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XIII. Aufteilung der Deckungsmasse (Exportkreditförderung) Ordentliche Deckung in Mio. EUR

Sitzland der gewährleistenden Stellen	Code (*)	Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Sonstige Schuldner	
		Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	44,0	114,1	44,0	114,1	0,0	0,0
Dänemark	DK	103,8	106,3	0,0	0,0	103,8	106,3
Niederlande	NL	112,5	133,3	112,5	133,3	0,0	0,0
Norwegen	NO	25,0	37,5	25,0	37,5	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	55,8	67,2	55,8	67,2	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	182,5	206,4	182,5	206,4	0,0	0,0
Summe		523,7	664,8	419,8	558,5	103,8	106,3

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XIV. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen		Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Regionale Gebietskörperschaft		davon: Örtliche Gebietskörperschaft		davon: Sonstige Schuldner	
Land	Code (*)	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kanada	CA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Niederlande	NL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Norwegen	NO	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe		0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen		Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Regionale Gebietskörperschaft		davon: Örtliche Gebietskörperschaft		davon: Sonstige Schuldner	
Land	Code (*)	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021	Q3/2022	Q3/2021
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kanada	CA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Niederlande	NL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Norwegen	NO	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe		0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

(*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



XVI. Kennzahlen zur Liquidität

Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 N. 6 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2022	Q3/2021**
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S.3 PfandBG	-245,7	
Am wievielten der nächsten 180 Tage ergibt sich diese größte negative Summe	122	
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S.3 PfandBG erfüllen	355,3	

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

Quartalsveröffentlichung per 30.09.2022 für öffentliche Pfandbriefe gemäß § 28 PfandBG



XVII. Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung nach § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG

Q3/2022	Q3/2021**
ISIN	ISIN
DE000DKOJTR7	
DE000DKOJTS5	
DE000DKOJTV9	
DE000DKOYUK9	
XS1760125283	
XS1875412980	
XS1952579495	
XS2021499871	

Q3/2022	Q3/2021**
ISIN	ISIN
XS2051657463	
XS2109453691	
XS2332799431	
XS2366703259	
XS2449929194	
XS2502402360	
XS2529513850	
XS2537088598	

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



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

		Q3/2022
WAL der Deckungsmasse (Total)	in Jahren	6,0
Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien)	in %	2,0

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q3/2022
EUR		4.467,2
USD		107,3

Aktuelles Pfandbriefrating (gemäß Ratingagentur)	Q3/2022
Moody's	Aaa



I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

Aufteilung der Forderungen gegenüber Zentralbanken und Kreditinstituten i.S.d. § 28 Absatz 1 Nr. 5 nach Bonitätsstufe	in Mio. EUR	Q3/2022
Bonitätsstufe 1		0,0
Bonitätsstufe 2		0,0

Kredite (*)		Q3/2022
Anzahl der Kredite		294
Anzahl der Kreditnehmer		95
Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer	in Mio. EUR	1.574,5
Volumen an Anleihen	in Mio. EUR	375,2
Volumen an Krediten	in Mio. EUR	4.170,1

Derivate		Q3/2022
Sind Derivate in Deckung?	Ja / Nein	Nein
Nettobarwert der Derivate in Deckung	in Mio. EUR	0,0
Typ der Swap-Kontrahenten (I=Intern, E=Extern, B=Beide, N=None)	(I, E, B, N)	N

(*) Hinweis: Die Berechnungen beziehen sich nur auf Titel der ordentlichen Deckung.



II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf

		Q3/2022
WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)	in Jahren	4,8
Sind Soft Bullet Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Ja
Wenn ja: Ausmaß der Fälligkeitsverschiebung?	in Monaten	12
Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt?	Ja / Nein	Ja
Sind Pass through Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Nicht anwendbar (**)

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q3/2022
EUR		4.004,1
USD		51,3

(**) Hinweis: Nicht anwendbar nach derzeitiger Rechtslage.