

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

2. Quartal 2024

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023
Hypothekendarlehen	(Mio. €)	2.500,0	3.080,5	2.429,1	2.935,9	2.429,1	2.765,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	2.986,6	3.844,4	3.003,0	3.969,5	2.990,7	3.642,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	486,6	763,9	573,9	1.033,5	561,6	877,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		19,5	24,8	23,6	35,2	23,1	31,7
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	103,4	127,3	48,6	58,7		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	383,3	636,6	525,3	974,8		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	486,6	763,9	573,9	1.033,5		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		19,5	24,8	23,6	35,2		

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

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	601,5	617,3	639,6	653,8	609,7	600,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	669,1	732,3	724,6	788,7	645,1	686,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	67,6	115,1	85,0	134,9	35,4	85,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		11,2	18,6	13,3	20,6	5,8	14,3
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	23,1	23,8	12,8	13,1		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	44,5	91,3	72,2	121,8		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	67,6	115,1	85,0	134,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		11,2	18,6	13,3	20,6		

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

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023
Schiffspfandbriefe	(Mio. €)	1.300,0	1.800,0	1.305,3	1.793,1	1.318,9	1.773,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.581,0	2.295,2	1.585,8	2.377,3	1.456,8	1.992,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	281,0	495,2	280,5	584,2	137,9	218,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		21,6	27,5	21,5	32,6	10,5	12,3
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	93,5	125,7	26,1	35,9		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	187,5	369,5	254,4	548,4		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	281,0	495,2	280,5	584,2		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		21,6	27,5	21,5	32,6		

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

¹ 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

² Vertraglich zugesicherte Überdeckung

³ 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
2. Quartal 2024

Hypothekendarlehen	Q2 2024		Q2 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	296,8	570,0	427,2
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	244,5	10,5	455,5
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	261,3	-	380,1
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	500,0	573,4	-	200,4
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	500,0	807,1	-	690,4
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.000,0	239,1	1.000,0	668,6
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	500,0	360,5	1.000,0	224,4
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	114,6	500,0	308,5
> 10 Jahre	-	89,3	-	489,3

Q2 2024 F&V (12 Monate)*	Q2 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
-	570,0
-	10,5
500,0	-
500,0	-
500,0	-
1.000,0	1.000,0
500,0	1.500,0
-	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q2 2024		Q2 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	27,6	162,1	12,0	55,1
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	70,2	8,4	10,0	9,1
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	87,0	7,6	26,5	160,5
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	30,5	6,4	69,4	7,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	137,0	53,2	116,5	13,6
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	16,5	10,0	137,0	52,1
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	15,6	18,2	16,5	10,1
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	122,4	28,8	135,7	42,8
> 10 Jahre	94,7	374,3	93,6	381,6

Q2 2024 F&V (12 Monate)*	Q2 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
27,6	12,0
70,2	10,0
117,5	95,9
137,0	116,5
16,5	137,0
138,1	132,2
94,7	113,6

Schiffspfandbriefe	Q2 2024		Q2 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	146,2	250,0	287,9
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	750,0	195,0	400,0	226,8
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	50,0	203,2	300,0	225,3
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	500,0	211,8	500,0	248,1
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	359,5	350,0	461,8
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	258,5	-	383,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	179,8	-	148,8
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	7,0	-	53,6
> 10 Jahre	-	20,0	-	259,9

Q2 2024 F&V (12 Monate)*	Q2 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
-	250,0
750,0	400,0
550,0	800,0
-	-
-	383,0
-	-
-	-
-	-
-	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q2 2024	Q2 2023
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit 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.	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit 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.	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 ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

**Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen
2. Quartal 2024**

Deckungswerte	Q2 2024 Mio. €	Q2 2023 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	8,2	9,4
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	27,4	28,7
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	531,3	597,5
Mehr als 10 Mio. €	2.234,4	2.615,8
Summe	2.801,3	3.251,5

**Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen
2. Quartal 2024**

Deckungswerte	Q2 2024 Mio. €	Q2 2023 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	33,7	44,2
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	276,5	280,8
Mehr als 100 Mio. €	359,0	407,3
Summe	669,1	732,3

**Zur Deckung von Schiffsdarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen
2. Quartal 2024**

Deckungswerte	Q2 2024 Mio. €	Q2 2023 Mio. €
Bis einschließlich 500 Tsd. €	0,8	0,5
Mehr als 500 Tsd. € bis einschließlich 5 Mio. €	188,7	222,1
Mehr als 5 Mio. €	1.323,9	1.717,7
Summe	1.513,5	1.940,3

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.

2. Quartal 2024

Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	2. 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		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. €			
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	2.801,3	554,6	-	2,5	531,1	21,0	-	2.246,7	763,4	707,0	-	649,6	120,4	6,3	-	-
	Jahr 2023	3.251,5	546,9	-	5,0	520,9	21,0	-	2.704,7	1.127,1	873,0	-	573,3	124,3	6,9	-	-
Deutschland	Jahr 2024	2.451,9	551,2	-	2,5	527,7	21,0	-	1.900,7	495,3	643,1	-	635,6	120,4	6,3	-	-
	Jahr 2023	2.879,4	534,3	-	5,0	508,3	21,0	-	2.345,1	815,5	825,4	-	573,0	124,3	6,9	-	-
Dänemark	Jahr 2024	14,1	-	-	-	-	-	-	14,1	-	-	-	14,1	-	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2024	15,7	-	-	-	-	-	-	15,7	15,7	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	15,7	-	-	-	-	-	-	15,7	15,7	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2024	7,8	-	-	-	-	-	-	7,8	7,8	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	7,7	-	-	-	-	-	-	7,7	7,7	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2024	294,8	3,4	-	-	3,4	-	-	291,4	227,5	63,9	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	270,9	12,6	-	-	12,6	-	-	258,3	211,5	46,5	-	0,3	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	1,1	-	-	-	-	-	-	1,1	-	1,1	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2024	17,1	-	-	-	-	-	-	17,1	17,1	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	76,8	-	-	-	-	-	-	76,8	76,8	-	-	-	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

2. Quartal 2024

Deckungswerte											
Staat	2. Quartal	Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		Mio. €	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörperschaften Mio. €	Örtliche Gebietskörperschaften Mio. €	Sonstige Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörperschaften Mio. €	Örtliche Gebietskörperschaften Mio. €	Sonstige Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	669,1	45,2	30,0	369,3	13,1	-	211,9	8,7	36,1	-
	Jahr 2023	732,3	55,4	30,0	419,1	55,0	-	177,7	11,4	39,1	-
Deutschland	Jahr 2024	361,9	45,2	-	260,4	13,1	-	45,2	7,3	36,1	-
	Jahr 2023	469,9	55,4	-	311,8	55,0	-	55,4	8,5	39,1	-
Belgien	Jahr 2024	31,4	-	30,0	-	-	-	-	1,4	-	-
	Jahr 2023	32,9	-	30,0	-	-	-	-	2,9	-	-
Portugal	Jahr 2024	83,0	-	-	-	-	-	83,0	-	-	-
	Jahr 2023	83,0	-	-	-	-	-	83,0	-	-	-
Schweiz	Jahr 2024	109,0	-	-	109,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	107,3	-	-	107,3	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2024	83,8	-	-	-	-	-	83,8	-	-	-
	Jahr 2023	39,3	-	-	-	-	-	39,3	-	-	-

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
2. Quartal 2024**

Staat	2. Quartal	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
		Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	3,7	3,7	-	-	-	45,2	45,2	-	-	-
	Jahr 2023	1,1	1,1	-	-	-	0,9	0,9	-	-	-
Deutschland	Jahr 2024	3,7	3,7	-	-	-	45,2	45,2	-	-	-
	Jahr 2023	1,1	1,1	-	-	-	0,9	0,9	-	-	-

Zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendete Forderungen nach Registerstaaten sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

2. Quartal 2024

Staat	2. Quartal	Deckungswerte			Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
		Summe	davon			
			Seeschiffe	Binnenschiffe		
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	1.513,5	1.513,5	-	-	-
	Jahr 2023	1.940,3	1.940,3	-	-	-
Deutschland	Jahr 2024	88,8	88,8	-		
	Jahr 2023	170,3	170,3	-		
Antigua und Barbuda	Jahr 2024	-	-	-		
	Jahr 2023	2,1	2,1	-		
Bahamas	Jahr 2024	19,6	19,6	-		
	Jahr 2023	29,9	29,9	-		
Belgien	Jahr 2024	3,1	3,1	-		
	Jahr 2023	-	-	-		
Bermuda	Jahr 2024	4,1	4,1	-		
	Jahr 2023	-	-	-		
Dänemark	Jahr 2024	18,2	18,2	-		
	Jahr 2023	44,7	44,7	-		
Griechenland	Jahr 2024	-	-	-		
	Jahr 2023	18,4	18,4	-		
Großbritannien	Jahr 2024	20,4	20,4	-		
	Jahr 2023	30,7	30,7	-		
Hongkong	Jahr 2024	16,8	16,8	-		
	Jahr 2023	46,3	46,3	-		
Liberia	Jahr 2024	335,4	335,4	-		
	Jahr 2023	490,3	490,3	-		
Malta	Jahr 2024	90,1	90,1	-		
	Jahr 2023	114,6	114,6	-		
Marshallinseln	Jahr 2024	562,8	562,8	-		
	Jahr 2023	649,4	649,4	-		
Panama	Jahr 2024	211,1	211,1	-		
	Jahr 2023	215,2	215,2	-		
Portugal	Jahr 2024	18,0	18,0	-		
	Jahr 2023	-	-	-		
Singapur	Jahr 2024	86,0	86,0	-		
	Jahr 2023	61,3	61,3	-		
Zypern	Jahr 2024	39,0	39,0	-		
	Jahr 2023	67,1	67,1	-		

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
2. Quartal 2024

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen 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	2. Quartal	Summe	davon		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4
			Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b)		Insgesamt	davon	
			Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	185,3	-	-	-	-	185,3
	Jahr 2023	592,8	-	-	-	-	592,8
Deutschland	Jahr 2024	54,0	-	-	-	-	54,0
	Jahr 2023	61,5	-	-	-	-	61,5
Frankreich	Jahr 2024	42,0	-	-	-	-	42,0
	Jahr 2023	42,0	-	-	-	-	42,0
USA	Jahr 2024	89,3	-	-	-	-	89,3
	Jahr 2023	489,3	-	-	-	-	489,3

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
2. Quartal 2024

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2, § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis b), § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4								
Staat	2. Quartal	Mio. €	davon		davon		davon	
			Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis b)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4	
			Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
Gesamtsumme - alle Staaten		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Schiffspfandbriefe
2. Quartal 2024

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe nach § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 3, § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 5, § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 4							
Staat	2. Quartal	Mio. €	davon		Forderungen gem. § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 5	Forderungen gem. § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 4	
			Forderungen gem. § 26 Abs. 1 S. 1 Nr. 3			Insgesamt	davon
			Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten							
	Jahr 2024	67,5	-	-	67,5	-	-
	Jahr 2023	354,9	-	-	354,9	-	-
Deutschland							
	Jahr 2024	25,0	-	-	25,0	-	-
	Jahr 2023	95,0	-	-	95,0	-	-
Frankreich							
	Jahr 2024	22,5	-	-	22,5	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-
USA							
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	259,9	-	-	259,9	-	-
EU-Institutionen							
	Jahr 2024	20,0	-	-	20,0	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-

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
2. Quartal 2024

Hypothekendarlehen		Q2 2024	Q2 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	2.500,0	3.080,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	2.986,6	3.844,4
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 12 Abs. 1, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 S. 2, 2. Halbsatz überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenzen nach § 19 Abs. 1 S. 7 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	57,9	57,7
Nettoanwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	14,3	-
	GBP	7,7	7,5
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	1,1
	USD	114,8	560,9
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,2	5,0
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	57,3	57,2
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe - (Durchschnitt)	%	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG			
Größe sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	12,5	416,0
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	21	20
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	185,3	586,4
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
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)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

2. Quartal 2024

Öffentliche Pfandbriefe		Q2 2024	Q2 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	601,5	617,3
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	90,0	90,3
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	669,1	732,3
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12		-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	80,8	81,4
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro			
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	103,7	109,2
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	71,0	39,2
	AUD	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG			
Größte 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. €)	122,8	73,0
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
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)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	6,7	0,1

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

2. Quartal 2024

Schiffspfandbriefe		Q2 2024	Q2 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	1.300,0	1.800,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	96,2	41,7
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.581,0	2.295,2
davon Gesamtbetrag der Schiffshypotheken nach § 21 , die die Grenzen nach § 22 Abs. 5 S. 2 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 26 Abs. 1, die die Grenzen nach § 26 Abs. 1 S. 6 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 26 Abs. 1 Nr. 5 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	5,1	16,2
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	1.321,5	2.114,0
	AUD	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG			
Größte 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. €)	61,1	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
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)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung
2. Quartal 2024

Hypothekendarlehen		
	Q2 2024	Q2 2023
ISIN	DE000HCB0BC0, DE000HCB0BH9, DE000HCB0BN7, DE000HCB0BP2, DE000HCB0BV0	DE000HCB0BC0, DE000HCB0BH9, DE000HCB0BN7, DE000HCB0BP2, DE000HCB0BV0, DE000HSH4MM4, DE000HSH4MZ6, DE000HSH4M73, DE000HSH6K16
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q2 2024	Q2 2023
ISIN	DE000A0D4ST5	DE000A0D4ST5
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-

Schiffspfandbriefe		
	Q2 2024	Q2 2023
ISIN	DE000HCB0BD8, DE000HCB0BL1, DE000HCB0B10, DE000HCB0B28	DE000HCB0AM1, DE000HCB0AT6, DE000HCB0AU4, DE000HCB0BD8, DE000HCB0BG1, DE000HCB0BL1, DE000HCB0BR8