

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
1. Quartal 2024

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	30.635,7	27.614,5	30.202,2	26.365,3	29.059,1	24.097,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	43.168,7	40.975,8	41.215,5	37.974,7	39.149,4	33.119,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	12.532,9	13.361,3	11.013,3	11.609,4	10.090,3	9.021,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		40,9	48,4	36,5	44,0	34,7	37,4
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	1.204,0	1.106,0	604,0	1.038,9		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	11.329,0	12.255,3	10.409,3	10.570,5		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	12.532,9	13.361,3	11.013,3	11.609,4		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		40,9	48,4	36,5	44,0		

* 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*	
		Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	9.037,2	8.643,0	9.604,0	9.172,3	9.215,0	8.331,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	16.285,5	14.752,5	16.743,0	15.145,8	15.520,4	12.553,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	7.248,3	6.109,5	7.139,0	5.973,4	6.305,5	4.221,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		80,2	70,7	74,3	65,1	68,4	50,7
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	371,3	356,4	192,1	361,0		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	6.877,0	5.753,1	6.946,9	5.612,4		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	7.248,3	6.109,5	7.139,0	5.973,4		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		80,2	70,7	74,3	65,1		

* 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*	
		Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023
Schiffspfandbriefe	(Mio. €)	49,0	59,0	50,2	60,7	49,5	56,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	78,5	79,0	74,9	73,3	73,3	66,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	29,5	20,0	24,7	12,6	23,8	9,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		60,2	33,9	49,1	20,8	48,2	17,6
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	3,5	4,2	1,0	3,9		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	26,0	15,8	23,7	8,7		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	28,9	20,0	24,1	12,6		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		59,1	33,9	48,0	20,8		

* 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
1. Quartal 2024

Hypothekendarlehen	Q1 2024		Q1 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	1.198,7	2.292,5	1.107,0	1.681,2
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	501,0	1.824,4	1.631,5	1.391,6
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	2.840,0	2.123,8	1.197,0	2.212,5
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	3.956,5	2.004,4	501,0	1.820,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	7.620,0	4.854,3	6.796,5	4.059,7
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.162,0	4.881,1	7.620,0	4.708,7
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	3.028,0	4.609,8	1.212,0	4.615,6
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	9.315,0	16.970,2	5.538,0	17.030,5
> 10 Jahre	1.014,5	3.598,3	2.011,5	3.456,0

Q1 2024 F&V (12 Monate)*	Q1 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
1.198,7	1.107,0
501,0	1.631,5
2.840,0	1.197,0
3.956,5	1.820,0
7.620,0	4.059,7
1.162,0	4.708,7
3.028,0	4.615,6
9.273,0	5.710,0
4.084,5	3.051,5

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2024		Q1 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	476,7	772,1	218,4	787,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.101,3	672,9	1.103,3	648,9
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.440,7	967,6	469,5	528,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	2.095,2	566,6	1.101,3	447,2
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.104,2	1.614,1	2.778,6	1.179,8
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	289,0	1.817,5	103,3	1.270,4
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	207,0	955,6	289,0	1.397,2
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.162,5	4.005,0	1.285,4	3.302,1
> 10 Jahre	1.160,6	4.914,1	1.294,2	5.191,2

Q1 2024 F&V (12 Monate)*	Q1 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
476,7	218,4
1.101,3	1.103,3
3.535,9	1.570,8
1.104,2	2.778,6
289,0	1.397,2
1.192,6	1.411,3
1.337,5	1.457,3

Schiffspfandbriefe	Q1 2024		Q1 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	5,0	7,0	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	-	10,0	7,0
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	-	5,0	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	44,0	57,0	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	-	44,0	57,5
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	14,5	-	-
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	-	-	14,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	-	-	-
> 10 Jahre	-	-	-	-

Q1 2024 F&V (12 Monate)*	Q1 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
5,0	-
-	10,0
44,0	5,0
-	44,0
-	-
-	-
-	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q1 2024	Q1 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. Entschieden 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. Entschieden 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

1. Quartal 2024

Deckungswerte	Q1 2024 Mio. €	Q1 2023 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	30.889,9	29.744,4
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	8.256,3	7.583,4
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	1.415,8	1.334,9
Mehr als 10 Mio. €	1.013,0	1.032,6
Summe	41.575,0	39.695,3

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

1. Quartal 2024

Deckungswerte	Q1 2024 Mio. €	Q1 2023 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	1.910,0	1.859,8
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	6.774,0	5.485,8
Mehr als 100 Mio. €	7.601,5	7.407,0
Summe	16.285,5	14.752,5

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 2024

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							
				Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €			
Insgesamt	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser							Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten						Bauplätze	Insgesamt	Bürogebäude
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	41.575,0	40.794,6	11.956,6	24.683,6	4.154,4	-	0,0	780,4	565,8	156,2	0,0	58,4	-	-	-	-	
	Jahr 2023	39.695,3	38.852,9	11.375,6	23.391,9	4.085,3	0,1	-	842,3	604,5	178,4	0,2	59,2	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2024	41.575,0	40.794,6	11.956,6	24.683,6	4.154,4	-	0,0	780,4	565,8	156,2	0,0	58,4	-	-	-	-	
	Jahr 2023	39.695,3	38.852,9	11.375,6	23.391,9	4.085,3	0,1	-	842,3	604,5	178,4	0,2	59,2	-	-	-	-	

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

1. Quartal 2024

Deckungswerte											
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	16.285,5	2.700,1	455,6	3.286,9	7.898,6	1.784,1	2.806,8	53,6	-	-
	Jahr 2023	14.752,5	2.202,8	620,2	3.737,1	7.699,7	223,5	2.202,8	60,0	-	209,4
Deutschland	Jahr 2024	12.906,8	1.653,6	-	2.622,1	6.761,4	1.763,0	1.760,3	-	-	-
	Jahr 2023	10.224,4	1.454,0	-	2.705,6	5.660,5	195,0	1.454,0	-	-	209,4
Belgien	Jahr 2024	60,1	6,5	-	-	-	-	6,5	53,6	-	-
	Jahr 2023	68,0	8,0	-	-	-	-	8,0	60,0	-	-
Dänemark	Jahr 2024	151,1	151,1	-	-	-	-	151,1	-	-	-
	Jahr 2023	80,0	80,0	-	-	-	-	80,0	-	-	-
Finnland	Jahr 2024	138,4	84,2	-	-	54,2	-	84,2	-	-	-
	Jahr 2023	71,1	11,9	-	-	59,1	-	11,9	-	-	-
Frankreich	Jahr 2024	222,3	200,8	-	11,5	10,1	-	200,8	-	-	-
	Jahr 2023	202,8	175,4	-	15,5	11,9	-	175,4	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2024	654,9	68,8	-	-	565,1	21,1	68,8	-	-	-
	Jahr 2023	1.491,6	85,5	-	-	1.406,1	-	85,5	-	-	-
Italien	Jahr 2024	363,2	-	44,7	131,3	187,2	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	462,2	-	44,3	189,6	228,3	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2024	111,0	111,0	-	-	-	-	111,0	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2024	400,3	5,3	395,0	-	-	-	5,3	-	-	-
	Jahr 2023	401,3	6,3	395,0	-	-	-	6,3	-	-	-
Schweden	Jahr 2024	1,1	1,1	-	-	-	-	1,1	-	-	-
	Jahr 2023	1,8	1,8	-	-	-	-	1,8	-	-	-
Spanien	Jahr 2024	23,1	-	-	23,1	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	360,1	-	165,0	195,1	-	-	-	-	-	-
Norwegen	Jahr 2024	37,3	37,3	-	-	-	-	37,3	-	-	-
	Jahr 2023	42,1	42,1	-	-	-	-	42,1	-	-	-
Schweiz	Jahr 2024	872,6	288,9	-	481,3	102,4	-	288,9	-	-	-
	Jahr 2023	856,6	184,5	-	571,8	100,3	-	184,5	-	-	-
Japan	Jahr 2024	42,0	-	-	-	42,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	42,0	-	-	42,0	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2024	33,5	-	15,9	17,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	33,3	-	15,8	17,5	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2024	176,2	-	-	-	176,2	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	261,9	-	-	-	233,4	28,5	-	-	-	-

übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2024	91,7	91,7	-	-	-	-	91,7	-	-	-
	Jahr 2023	153,3	153,3	-	-	-	-	153,3	-	-	-

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

		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 2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
1. 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	1. 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			
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	1.593,7	-	-	-	-	1.593,7
	Jahr 2023	1.280,5	-	-	-	-	1.280,5
Deutschland	Jahr 2024	545,0	-	-	-	-	545,0
	Jahr 2023	675,0	-	-	-	-	675,0
Italien	Jahr 2024	663,7	-	-	-	-	663,7
	Jahr 2023	505,5	-	-	-	-	505,5
Österreich	Jahr 2024	100,0	-	-	-	-	100,0
	Jahr 2023	100,0	-	-	-	-	100,0
Portugal	Jahr 2024	125,0	-	-	-	-	125,0
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2024	160,0	-	-	-	-	160,0
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
1. 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	1. 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
1. 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	1. 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	78,5	-	-	78,5	-	-
	Jahr 2023	79,0	-	-	79,0	-	-
Deutschland							
	Jahr 2024	71,5	-	-	71,5	-	-
	Jahr 2023	72,0	-	-	72,0	-	-
Griechenland							
	Jahr 2024	7,0	-	-	7,0	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-
Slowakei							
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	7,0	-	-	7,0	-	-

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 2024

Hypothekendarlehen		Q1 2024	Q1 2023
Umlaufende Pfandbriefe			
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	30.635,7	27.614,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	77,1	74,6
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	43.168,7	40.975,8
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. €)	-	-
§ 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	%	98,1	98,0
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	-	-
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)	Jahre	5,3	5,1
§ 28 Abs. 2 Nr. 4			
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	%	51,1	51,6
§ 28 Abs. 2 Nr. 3			
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. €)	653,4	418,9
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	123	179
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	1.451,6	1.201,4
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

1. Quartal 2024

Öffentliche Pfandbriefe		Q1 2024	Q1 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	9.037,2	8.643,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	61,8	49,0
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	16.285,5	14.752,5
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	%	77,4	76,7
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro			
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	281,6	389,0
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	548,3	1.174,6
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	1.031,8	1.027,5
	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. €)	6,5	48,7
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	1	13
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	636,8	966,4
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.	%	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

1. Quartal 2024

Schiffspfandbriefe		Q1 2024	Q1 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	49,0	59,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	78,5	79,0
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	%	100,0	100,0
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	-	-	
AUD	-	-	
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. €)	5,2	0,2
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	144	143
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	74,8	73,4
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
1. Quartal 2024**

Hypothekendarlehen		
	Q1 2024	Q1 2023
ISIN	DE000CB0HR27, DE000CB0HR43, DE000CB0HR50, DE000CZ40KZ0, DE000CZ40LG8, DE000CZ40LM6, DE000CZ40LQ7, DE000CZ40MB7, DE000CZ40MH4, DE000CZ40MN2, DE000CZ40MQ5, DE000CZ40MU7, DE000CZ40MV5, DE000CZ40NP5, DE000CZ40NU5, DE000CZ40NY7, DE000CZ439P6, DE000CZ43Z23, DE000CZ43Z25, DE000CZ43Z27, DE000CZ43ZE7, DE000CZ43ZF4, DE000CZ43ZJ6, DE000CZ43ZS7, DE000CZ43ZW9, DE000CZ43ZX7, DE000CZ45VF8, DE000CZ45VS1, DE000CZ45W08, DE000CZ45W16, DE000CZ45W24, DE000CZ45W32, DE000CZ45W40, DE000CZ45W65, DE000CZ45W73, DE000CZ45W99, DE000CZ45WY7, DE000CZ45YB1, DE000EH1A3P2	DE000CB0HR27, DE000CB0HR43, DE000CB0HR50, DE000CZ40J26, DE000CZ40KZ0, DE000CZ40LG8, DE000CZ40LM6, DE000CZ40LQ7, DE000CZ43ZS7, DE000CZ43ZW9, DE000CZ40MB7, DE000CZ40MH4, DE000CZ40MJ0, DE000CZ40MN2, DE000CZ40MQ5, DE000CZ40MU7, DE000CZ40MV5, DE000CZ40MW3, DE000CZ40NN0, DE000CZ40NP5, DE000CZ40NU5, DE000CZ40NY7, DE000CZ43ZE7, DE000CZ43ZF4, DE000CZ43ZJ6, DE000CZ45VF8, DE000CZ45VS1, DE000CZ45W08, DE000CZ45W16, DE000CZ45W24, DE000CZ45W32, DE000CZ45W40, DE000CZ45W65, DE000CZ45W73, DE000CZ45W99, DE000CZ45WY7, DE000EH1A3P2

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q1 2024	Q1 2023
ISIN	CH0026096567, DE000CB0HR19, DE000CZ43Z15, DE000CZ439N1, DE000CZ45VW3, DE000CZ45V33, DE000EH0A1W3, DE000HBE1MF6	CH0026096567, DE000CB0HR19, DE000CZ45V33, DE000CZ45VW3, DE000CZ45VX1, DE000EH0A1W3, DE000HBE1MF6