

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte
3. Quartal 2024

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen	Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023
Hypothekendarbriefe (Mio. €)	29.187,2	29.859,5	29.178,4	28.532,2	28.123,7	26.880,2
darunter Derivate (Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse (Mio. €)	43.295,5	42.186,0	42.229,3	38.710,2	40.323,0	35.522,2
darunter Derivate (Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung (Mio. €)	14.108,3	12.326,5	13.050,9	10.177,9	12.199,3	8.642,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	48,3	41,3	44,7	35,7	43,4	32,1
Gesetzliche Überdeckung ¹ (Mio. €)	1.146,3	1.186,8	583,6	570,6		
Vertragliche Überdeckung ² (Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³ (Mio. €)	12.962,0	11.139,7	12.467,3	9.607,3		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells (Mio. €)	14.108,3	12.326,5	13.050,9	10.177,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	48,3	41,3	44,7	35,7		

* 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*	
	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023
Öffentlichen Pfandbriefe (Mio. €)	8.804,9	9.231,4	9.520,7	9.584,0	9.170,9	8.999,1
darunter Derivate (Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse (Mio. €)	18.029,7	15.539,2	18.852,1	15.383,5	17.610,0	13.565,7
darunter Derivate (Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung (Mio. €)	9.224,7	6.307,7	9.331,4	5.799,4	8.439,1	4.566,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	104,8	68,3	98,0	60,5	92,0	50,7
Gesetzliche Überdeckung ¹ (Mio. €)	358,5	378,5	190,4	191,7		
Vertragliche Überdeckung ² (Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³ (Mio. €)	8.866,2	5.929,3	9.141,0	5.607,8		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells (Mio. €)	9.224,7	6.307,7	9.331,4	5.799,4		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	104,8	68,3	98,0	60,5		

* 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*	
	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023
Schiffspfandbriefe (Mio. €)	44,0	59,0	46,1	61,1	45,7	59,3
darunter Derivate (Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse (Mio. €)	76,5	78,5	74,6	73,3	73,4	70,0
darunter Derivate (Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung (Mio. €)	32,5	19,5	28,5	12,2	27,7	10,7
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	73,9	33,1	61,8	19,9	60,7	18,1
Gesetzliche Überdeckung ¹ (Mio. €)	3,1	4,2	0,9	1,2		
Vertragliche Überdeckung ² (Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³ (Mio. €)	29,4	15,3	27,6	11,0		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells (Mio. €)	32,1	19,5	28,1	12,2		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	73,0	33,1	60,9	19,9		

* 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
3. Quartal 2024

Hypothekendarlehen	Q3 2024		Q3 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	502,7	1.826,4	1.633,5	1.582,7
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	2.840,0	2.192,2	1.197,0	2.243,1
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.956,5	1.989,0	501,0	1.818,9
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	5.365,0	2.635,9	2.840,0	2.099,2
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	3.365,0	5.090,2	9.321,5	4.577,0
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	2.221,0	4.648,2	3.405,0	4.755,4
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	3.919,0	4.874,1	2.221,0	4.481,9
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	7.867,0	16.614,1	6.659,0	17.076,3
> 10 Jahre	1.151,0	3.425,5	2.081,5	3.551,6

Q3 2024 F&V (12 Monate)*	Q3 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
502,7	1.633,5
2.840,0	1.197,0
7.321,5	3.341,0
3.365,0	9.321,5
2.221,0	3.405,0
9.771,0	8.075,0
3.166,0	2.886,5

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2024		Q3 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	153,5	721,8	1.105,5	686,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	450,5	1.060,6	469,5	736,9
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	2.096,0	609,7	1.101,3	498,7
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	62,2	959,2	1.443,5	906,6
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.198,0	1.435,5	2.155,7	1.247,9
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	273,0	1.910,3	198,0	1.042,4
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	391,0	1.284,4	273,0	1.691,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.167,4	4.478,1	1.302,9	3.630,3
> 10 Jahre	1.013,2	5.569,9	1.182,0	5.098,4

Q3 2024 F&V (12 Monate)*	Q3 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
153,5	1.105,5
450,5	469,5
2.158,3	2.544,9
1.198,0	2.155,7
273,0	198,0
2.373,4	1.410,8
2.198,2	1.347,0

Schiffspfandbriefe	Q3 2024		Q3 2023	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	-	10,0	7,0
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	-	5,0	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	44,0	57,0	-	-
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	-	-	-
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	19,5	44,0	57,0
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	-	-	14,5
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	-	-	-
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	-	-	-
> 10 Jahre	-	-	-	-

Q3 2024 F&V (12 Monate)*	Q3 2023 F&V (12 Monate)*
Pfandbriefumlauf Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €
-	-
-	-
-	10,0
-	5,0
44,0	-
-	44,0
-	-
-	-
-	-
-	-

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q3 2024	Q3 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.
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
3. Quartal 2024**

Deckungswerte	Q3 2024 Mio. €	Q3 2023 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	30.752,0	30.320,1
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	8.344,1	7.874,3
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	1.426,7	1.380,5
Mehr als 10 Mio. €	1.181,0	1.030,6
Summe	41.703,8	40.605,5

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

Deckungswerte	Q3 2024 Mio. €	Q3 2023 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	2.019,4	1.891,8
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	7.677,9	6.547,8
Mehr als 100 Mio. €	8.332,3	7.099,6
Summe	18.029,7	15.539,2

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.

3. 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	3. 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	Bauplätze		
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €			
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	41.703,8	40.764,0	11.976,2	24.691,3	4.096,5	-	0,0	939,8	786,7	100,0	0,0	53,1	-	-	-	-	
	Jahr 2023	40.605,5	39.807,8	11.648,6	24.024,5	4.134,7	0,1	-	797,7	566,4	173,3	0,0	58,0	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2024	41.703,8	40.764,0	11.976,2	24.691,3	4.096,5	-	0,0	939,8	786,7	100,0	0,0	53,1	-	-	-	-	
	Jahr 2023	40.605,5	39.807,8	11.648,6	24.024,5	4.134,7	0,1	-	797,7	566,4	173,3	0,0	58,0	-	-	-	-	

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

3. Quartal 2024

Deckungswerte											
Staat	3. 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	18.029,7	2.610,7	449,6	3.205,5	9.298,5	2.040,5	2.872,3	163,3	-	-
	Jahr 2023	15.539,2	2.633,5	455,8	3.489,1	7.263,8	1.533,9	2.740,2	55,0	1,5	-
Deutschland	Jahr 2024	14.571,3	1.610,8	-	2.526,3	8.290,8	2.028,5	1.610,8	114,9	-	-
	Jahr 2023	11.706,5	1.724,3	-	2.773,4	5.589,1	1.513,0	1.831,0	-	-	-
Belgien	Jahr 2024	54,2	5,8	-	-	-	-	5,8	48,4	-	-
	Jahr 2023	62,3	7,3	-	-	-	-	7,3	55,0	-	-
Dänemark	Jahr 2024	145,0	145,0	-	-	-	-	145,0	-	-	-
	Jahr 2023	77,8	77,8	-	-	-	-	77,8	-	-	-
Finnland	Jahr 2024	143,8	93,1	-	-	50,7	-	93,1	-	-	-
	Jahr 2023	106,9	51,3	-	-	55,6	-	51,3	-	-	-
Frankreich	Jahr 2024	206,4	187,7	-	10,5	8,2	-	187,7	-	-	-
	Jahr 2023	229,2	204,6	-	14,5	10,1	-	204,6	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2024	530,1	69,1	-	-	449,1	12,0	69,1	-	-	-
	Jahr 2023	1.196,1	79,0	-	-	1.094,9	20,8	79,0	-	1,5	-
Italien	Jahr 2024	362,1	-	44,9	130,6	186,6	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	404,3	-	44,5	132,0	227,8	-	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2024	118,9	118,9	-	-	-	-	118,9	-	-	-
	Jahr 2023	102,7	102,7	-	-	-	-	102,7	-	-	-
Österreich	Jahr 2024	399,7	4,7	395,0	-	-	-	4,7	-	-	-
	Jahr 2023	400,8	5,8	395,0	-	-	-	5,8	-	-	-
Polen	Jahr 2024	261,7	-	-	-	-	-	261,7	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2024	0,7	0,7	-	-	-	-	0,7	-	-	-
	Jahr 2023	1,4	1,4	-	-	-	-	1,4	-	-	-
Spanien	Jahr 2024	23,1	-	-	23,1	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	23,1	-	-	23,1	-	-	-	-	-	-
Norwegen	Jahr 2024	34,9	34,9	-	-	-	-	34,9	-	-	-
	Jahr 2023	39,7	39,7	-	-	-	-	39,7	-	-	-
Schweiz	Jahr 2024	861,7	257,8	-	497,9	105,9	-	257,8	-	-	-
	Jahr 2023	855,3	265,8	-	486,1	103,4	-	265,8	-	-	-
Japan	Jahr 2024	42,0	-	-	-	42,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	42,0	-	-	42,0	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2024	26,6	-	9,6	17,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	34,2	-	16,2	17,9	-	-	-	-	-	-

USA	Jahr 2024	165,2	-	-	-	165,2	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	183,0	-	-	-	183,0	-	-	-	-	-
übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2024	82,2	82,2	-	-	-	-	82,2	-	-	-
	Jahr 2023	73,7	73,7	-	-	-	-	73,7	-	-	-

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
3. 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	3. Quartal	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
3. 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	3. 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				davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024		1.591,8	-	-	-	-	1.591,8
	Jahr 2023		1.580,5	-	-	-	-	1.580,5
Deutschland	Jahr 2024		545,0	-	-	-	-	545,0
	Jahr 2023		695,0	-	-	-	-	695,0
Italien	Jahr 2024		661,8	-	-	-	-	661,8
	Jahr 2023		625,5	-	-	-	-	625,5
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		160,0	-	-	-	-	160,0

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
3. 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	Summe	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
3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Schiffspfandbriefe
3. 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	3. 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	76,5	-	-	76,5	-	-
	Jahr 2023	78,5	-	-	78,5	-	-
Deutschland							
	Jahr 2024	71,5	-	-	71,5	-	-
	Jahr 2023	71,5	-	-	71,5	-	-
Griechenland							
	Jahr 2024	5,0	-	-	5,0	-	-
	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
3. Quartal 2024

Hypothekendarlehen		Q3 2024	Q3 2023
Umlaufende Pfandbriefe			
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	29.187,2	29.859,5
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	83,1	76,5
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	43.295,5	42.186,0
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	%	97,6	98,1
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	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 2 Nr. 4	Jahre	5,4	5,2
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	50,8	51,3
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. €)	34,4	1.035,5
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	28	122
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	1.474,8	1.421,1
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

3. Quartal 2024

Öffentliche Pfandbriefe		Q3 2024	Q3 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	8.804,9	9.231,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	60,2	52,3
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	18.029,7	15.539,2
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	%	78,5	75,8
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro			
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	289,5	279,8
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	448,5	812,7
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	991,0	1.024,4
	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. €)	-	440,1
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	-	179
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	628,7	658,7
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

3. Quartal 2024

Schiffspfandbriefe		Q3 2024	Q3 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	44,0	59,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	76,5	78,5
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. €)	1,7	12,1
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	112	115
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	74,6	73,3
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
3. Quartal 2024**

Hypothekendarlehenpfandbriefe		
	Q3 2024	Q3 2023
ISIN	DE000CB0HR27, DE000CB0HR43, DE000CB0HR50, DE000CZ40KZ0, DE000CZ40LGB, DE000CZ40LQ7, DE000CZ40MB7, DE000CZ40MN2, DE000CZ40MQ5, DE000CZ40MU7, DE000CZ40MV5, DE000CZ40NP5, DE000CZ40NU5, DE000CZ40NY7, DE000CZ439P6, DE000CZ43Z23, DE000CZ43Z56, DE000CZ43Z72, DE000CZ43ZE7, DE000CZ43ZF4, DE000CZ43ZJ6, DE000CZ43ZS7, DE000CZ43ZW9, DE000CZ43ZX7, DE000CZ45VF8, DE000CZ45VS1, DE000CZ45W16, DE000CZ45W24, DE000CZ45W32, DE000CZ45W40, DE000CZ45W65, DE000CZ45W73, DE000CZ45W99, DE000CZ45WY7, DE000CZ45Y22, DE000CZ45YB1, DE000CZ45YG0, DE000CZ45YK2, DE000CZ45YL0, DE000CZ45YX5	DE000CB0HR27, DE000CB0HR43, DE000CB0HR50, DE000CZ40J26, DE000CZ40KZ0, DE000CZ40LGB, DE000CZ40LM6, DE000CZ40LQ7, DE000CZ40MB7, DE000CZ40MH4, DE000CZ40MN2, DE000CZ40MQ5, DE000CZ40MU7, DE000CZ40MV5, DE000CZ40NNO, DE000CZ40NP5, DE000CZ40NU5, DE000CZ40NY7, DE000CZ43ZE7, DE000CZ43ZF4, DE000CZ43ZJ6, DE000CZ43ZS7, DE000CZ43ZW9, DE000CZ43ZX7, DE000CZ43Z23, DE000CZ43Z56, DE000CZ43Z72, DE000CZ45VF8, DE000CZ45VS1, DE000CZ45WY7, DE000CZ45W08, DE000CZ45W16, DE000CZ45W24, DE000CZ45W32, DE000CZ45W40, DE000CZ45W65, DE000CZ45W73, DE000CZ45W99, DE000EH1A3P2
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q3 2024	Q3 2023
ISIN	CH0026096567, DE000CB0HR19, DE000CZ439N1, DE000CZ43Z15, DE000CZ45YM8, DE000CZ45YU1, DE000EH0A1W3, DE000HBE1MF6	CH0026096567, DE000CB0HR19, DE000CZ43Z15, DE000EH0A1W3, DE000CZ45VX1, DE000CZ45V33, DE000CZ45VW3, DE000HBE1MF6
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-
ISIN	-	-