

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. €)	18.234,4	17.514,6	17.634,6	16.338,4	18.682,0	18.267,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	19.090,0	18.395,2	18.996,9	17.725,2	19.720,2	19.055,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	855,6	880,6	1.362,3	1.386,8	1.038,2	787,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,7	5,0	7,7	8,5	5,6	4,3
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	714,0	679,5	352,7	326,8		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	141,6	201,1	1.009,6	1.060,0		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	855,6	880,6	1.362,3	1.386,8		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,7	5,0	7,7	8,5		

* 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*	
		Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	131,0	191,0	136,5	205,2	132,8	186,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	163,1	224,3	185,6	241,1	166,2	205,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	32,1	33,2	49,2	35,9	33,3	18,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,5	17,4	36,0	17,5	25,1	10,1
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	5,4	8,1	2,7	4,1		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	26,7	25,1	46,4	31,8		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	32,1	33,2	49,2	35,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,5	17,4	36,0	17,5		

* 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		Q1 2024	Q1 2023
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	885,5	1.036,6	807,8	816,9	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	584,0	1.360,1	1.150,0	1.086,4	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	1.342,0	1.165,4	635,0	968,1	885,5	807,8
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	1.567,5	1.549,3	584,0	1.620,0	584,0	1.150,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.996,8	2.689,8	2.459,5	2.420,2	2.909,5	1.219,0
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	3.195,0	2.956,9	1.992,6	2.725,2	1.996,8	2.459,5
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.612,0	2.184,3	2.720,0	2.325,0	3.195,0	1.992,6
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	6.158,5	5.728,2	5.530,5	5.980,2	7.015,5	6.962,0
> 10 Jahre	893,1	419,4	1.635,2	453,2	1.648,1	2.923,7

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2024		Q1 2023		Q1 2024	Q1 2023
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	0,0	0,6	0,0	0,3	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	3,3	10,0	5,3	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	20,0	5,7	-	0,5	0,0	0,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	15,0	0,2	-	3,3	-	10,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	96,0	2,2	35,0	11,5	35,0	-
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	0,5	96,0	2,2	96,0	35,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	0,1	-	50,5	-	96,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	0,5	-	0,6	-	-
> 10 Jahre	-	150,0	50,0	150,1	-	50,0

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 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.	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Der 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 Laufzeitstruktur 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. €	16,4	21,3
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	65,4	72,8
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	2.209,0	2.299,3
Mehr als 10 Mio. €	15.544,3	14.224,3
Summe	17.835,0	16.617,7

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

1. Quartal 2024

Deckungswerte	Q1 2024 Mio. €	Q1 2023 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	13,1	13,3
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	150,0	211,0
Mehr als 100 Mio. €	-	-
Summe	163,1	224,3

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.

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			Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze	Mio. €	davon							
				Insgesamt	Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser				Mehrfamilien- häuser	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	17.835,0	6.101,8	47,6	158,7	5.834,3	-	61,1	11.733,2	5.916,7	3.555,6	128,7	2.052,4	79,4	0,4	0,0	-
	Jahr 2023	16.617,7	5.479,5	30,6	144,9	5.304,0	-	-	11.138,2	5.709,3	3.279,6	113,7	1.904,6	79,4	51,6	0,0	-
Deutschland	Jahr 2024	11.837,4	5.091,6	30,8	7,6	4.992,2	-	61,1	6.745,7	2.909,9	2.149,2	124,7	1.482,2	79,4	0,4	0,0	-
	Jahr 2023	11.204,1	4.778,5	30,4	8,9	4.739,2	-	-	6.425,6	2.816,7	1.939,4	109,7	1.428,9	79,4	51,6	0,0	-
Belgien	Jahr 2024	62,3	-	-	-	-	-	-	62,3	62,3	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	55,7	-	-	-	-	-	-	55,7	55,7	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2024	1.412,8	14,6	-	-	14,6	-	-	1.398,2	1.023,4	249,4	-	125,3	-	-	-	-
	Jahr 2023	1.401,0	5,2	-	-	5,2	-	-	1.395,9	966,7	319,3	-	109,9	-	-	-	-
Niederlande	Jahr 2024	3.245,9	995,5	16,9	151,1	827,5	-	-	2.250,4	1.112,6	838,5	4,0	295,3	-	-	-	-
	Jahr 2023	2.758,1	695,8	0,2	136,0	559,6	-	-	2.062,3	1.055,3	704,3	4,0	298,7	-	-	-	-
Polen	Jahr 2024	1.059,2	-	-	-	-	-	-	1.059,2	662,7	246,9	-	149,6	-	-	-	-
	Jahr 2023	951,4	-	-	-	-	-	-	951,4	639,3	245,0	-	67,1	-	-	-	-
Tschechien	Jahr 2024	217,5	-	-	-	-	-	-	217,5	145,8	71,7	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	247,4	-	-	-	-	-	-	247,4	175,7	71,7	-	-	-	-	-	-

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	163,1	-	50,0	100,0	-	5,5	-	7,6	-	-
	Jahr 2023	224,3	-	50,0	161,0	-	5,0	-	8,3	-	-
Deutschland	Jahr 2024	113,1	-	-	100,0	-	5,5	-	7,6	-	-
	Jahr 2023	174,3	-	-	161,0	-	5,0	-	8,3	-	-
Österreich	Jahr 2024	50,0	-	50,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	50,0	-	50,0	-	-	-	-	-	-	-

**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	Mio. €	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	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten							
	Jahr 2024	1.255,0	343,5	293,5	506,5	506,5	405,0
	Jahr 2023	1.777,5	402,5	402,5	556,5	466,5	818,5
Deutschland							
	Jahr 2024	828,5	343,5	293,5	150,0	150,0	335,0
	Jahr 2023	1.208,5	402,5	402,5	102,0	102,0	704,0
Frankreich							
	Jahr 2024	372,5	-	-	302,5	302,5	70,0
	Jahr 2023	180,0	-	-	180,0	90,0	-
Polen							
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	39,5	-	-	-	-	39,5
Schweden							
	Jahr 2024	54,0	-	-	54,0	54,0	-
	Jahr 2023	30,0	-	-	30,0	30,0	-
Kanada							
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	319,5	-	-	244,5	244,5	75,0

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		Jahr 2024		Jahr 2023				
			Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
		-	-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-	-

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. €)	18.234,4	17.514,6
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	97,4	99,9
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	19.090,0	18.395,2
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	%	75,6	75,5
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro	CAD	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CHF	-233,8	-209,5
	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	4,5	4,4
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. €)	336,6	791,3
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	52	57
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	1.177,0	1.606,5
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.	%	0,0	0,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

1. Quartal 2024

Öffentliche Pfandbriefe		Q1 2024	Q1 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	131,0	191,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	100,0	100,0
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	163,1	224,3
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	%	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			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	-	2,1
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	-	22
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	5,3	15,3
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.	%	-	-

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

Hypothekendarlehen		
	Q1 2024	Q1 2023
ISIN	CH1202242249, DE000BHY0AUS, DE000BHY0BE0, DE000BHY0BN1, DE000BHY0BQ4, DE000BHY0BV4, DE000BHY0BZ5, DE000BHY0B14, DE000BHY0C47, DE000BHY0C70, DE000BHY0C88, DE000BHY0GC3, DE000BHY0GD1, DE000BHY0GE9, DE000BHY0GK6, DE000BHY0GL4, DE000BHY0GM2, DE000BHY0GQ3, DE000BHY0GT7, DE000BHY0GX9, DE000BHY0GY7, DE000BHY0GZ4, DE000BHY0HC1, DE000BHY0HM0, DE000BHY0HN8, DE000BHY0HP3, DE000BHY0HW9, DE000BHY0H22, DE000BHY0H34, DE000BHY0JB9, DE000BHY0JC7, DE000BHY0JD5, DE000BHY0JJ2, DE000BHY0JS3, DE000BHY0JU9, DE000BHY0JW5, DE000BHY0JX3, DE000BHY0JY1, DE000BHY0J08, DE000BHY0MQ1, DE000BHY0MX7, DE000BHY0SB0, DE000BHY0SC8, DE000BHY0SP0, DE0002180064, DE0002190097, DE0002190220, DE0002190253, DE0002190295, DE0002190303, DE0002190329, DE0002190337, DE0002190345, DE0002190402, DE0002190436, DE0002190444, DE0002190485, DE0002190543, DE0002190725, DE0002190741, DE0002190782, DE0002190832, DE0002190972, DE0002200409, DE0002200003, DE0002200250, DE0002200359, DE0002200375, DE0002200417, DE0002200417, DE0002200425, DE0002200441, DE0002200458, DE0002200466, DE0002200516, DE0002200532, DE0002200557, DE0002200565, DE0002200573, DE0002200599, DE0002200615, DE0002200623, DE0002200649, DE0002200664, DE0002200672, DE0002200680, DE0002200698, DE0002200706, DE0002200714, DE0002200763, DE0002210028	CH1202242249, DE000BHY0AUS, DE000BHY0BE0, DE000BHY0BN1, DE000BHY0BQ4, DE000BHY0BV4, DE000BHY0BZ5, DE000BHY0B14, DE000BHY0C47, DE000BHY0C70, DE000BHY0C88, DE000BHY0GC3, DE000BHY0GD1, DE000BHY0GE9, DE000BHY0GH2, DE000BHY0GK6, DE000BHY0GL4, DE000BHY0GM2, DE000BHY0GQ3, DE000BHY0GX9, DE000BHY0HC1, DE000BHY0HK4, DE000BHY0HM0, DE000BHY0HN8, DE000BHY0HP3, DE000BHY0HW9, DE000BHY0H22, DE000BHY0H34, DE000BHY0JB9, DE000BHY0JC7, DE000BHY0JD5, DE000BHY0JJ2, DE000BHY0JS3, DE000BHY0JU9, DE000BHY0JW5, DE000BHY0JX3, DE000BHY0JY1, DE000BHY0MQ1, DE000BHY0MT5, DE000BHY0MX7, DE000BHY0SB0, DE000BHY0SP0, DE000BHY0150, DE0002180064, DE0002190097, DE0002190204, DE0002190220, DE0002190253, DE0002190295, DE0002190303, DE0002190329, DE0002190337, DE0002190345, DE0002190402, DE0002190436, DE0002190444, DE0002190485, DE0002190543, DE0002190659, DE0002190725, DE0002190741, DE0002190782, DE0002190832, DE0002190972, DE0002191020, DE0002200003, DE0002200250, DE0002200359, DE0002200375, DE0002200409, DE0002200417, DE0002200425, DE0002200441, DE0002200458, DE0002200466, DE0002200516, DE0002200532, DE0002200557, DE0002200565, DE0002200573, DE0002200599, DE0002200615, DE0002200623, DE0002200649, DE0002200664, DE0002200672, DE0002200680, DE0002200698, DE0002200706, DE0002200714, DE0002200763, DE0002210028

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q1 2024	Q1 2023
ISIN	DE0002193315, DE0002193372, DE0002193646, DE0002203213	DE0002193315, DE0002193372, DE0002193646, DE0002203213, DE0002206737