

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 und 3 PfandBG  
Umlaufende Hypothekendarlehen und dafür verwendete Deckungswerte

	Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023
	Mio. €					
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Hypothekendarlehen</b>	15.233,3	15.119,9	15.117,9	14.555,2	15.352,8	15.206,5
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
<b>Deckungsmasse</b>	19.751,1	19.230,5	19.945,4	19.152,8	19.994,3	19.422,4
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	<b>4.517,8</b>	<b>4.110,5</b>	<b>4.827,4</b>	<b>4.597,6</b>	<b>4.641,6</b>	<b>4.215,9</b>
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	29,7%	27,2%	31,9%	31,6%	30,2%	27,7%
Gesetzliche Überdeckung**	593,4	579,1	302,4	291,1	0,0	0,0
Vertragliche Überdeckung**	0,0	0,0	0,0	0,0%	0,00	0,0%
Freiwillige Überdeckung**	3.924,4	3.531,4	4.525,1	4.306,5	0,0	0,0
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	4.508,0	4.107,2	4.817,0	4.594,2	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	29,6%	27,2%	31,9%	31,6%	-	-

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

\*\* Das gesetzliche Überdeckungserfordernis setzt sich aus der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG inkl. Zins- und Währungsstressszenarien und der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG zusammen.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4, 5 PfandBG

**Laufzeitstruktur der umlaufenden Hypothekendarlehen und der dafür verwendeten Deckungsmassen**

	Q2 2024		Q2 2023		Q2 2024	Q1 2023*
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	FäV (12 Monate) Pfandbriefumlauf	FäV (12 Monate) Pfandbriefumlauf
Restlaufzeit:	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<= 0,5 Jahre	849,7	3.267,0	647,7	3.450,6	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.071,1	1.989,8	2.966,8	1.616,8	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	899,5	2.028,0	835,6	2.007,9	849,7	647,7
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	970,5	1.251,6	1.059,1	1.532,1	1.071,1	2.966,8
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	5.529,4	3.754,0	1.870,0	2.528,0	1.870,0	1.894,7
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	2.149,1	2.412,5	2.386,8	2.375,1	5.529,4	1.870,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	585,0	2.403,8	1.649,1	1.828,9	2.149,1	2.386,8
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	767,5	2.412,7	1.189,5	3.592,4	1.166,0	2.647,6
> 10 Jahre	2.411,5	231,7	2.515,4	298,7	2.598,0	2.706,4
<b>Summe</b>	<b>15.233,3</b>	<b>19.751,1</b>	<b>15.119,9</b>	<b>19.230,5</b>	<b>15.233,3</b>	<b>15.119,9</b>

\*Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um eine äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Insolvenz der Pfandbriefbank zur Geltung kommen könnte.

**Informationen zu Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe**

Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 Absatz 2a

Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 Absatz 2a PfandBG

**Q2 2024 / Q2 2023**

Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsunfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsunfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch §30 Abs. 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 überschreiben 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 Höchstverschiebedauer von 12 Monaten zu berücksichtigen. Der Sachwalter darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe 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 Abs. 2a und 2b PfandBG

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 8, 9, 10 PfandBG  
Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen - Detaildarstellung

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen nach § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 a) und b), Nr.3 a) bis c) und Nr. 4							
		Insgesamt	davon				
			Forderungen nach § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2a) und b)		Forderungen nach § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3a) bis c)		Forderung gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 4
			Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Mio. €	Mio. €	Mio. €		Mio. €		Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	<b>Q2 2024</b>	<b>665,3</b>	-	-	-	-	<b>665,3</b>
	Q2 2023	549,4	-	-	184,6	-	364,8
Deutschland	Q2 2024	100,0	-	-	-	-	100,0
	Q2 2023	10,2	-	-	-	-	10,2
Irland	Q2 2024	75,0	-	-	-	-	75,0
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-
Italien	Q2 2024	115,0	-	-	-	-	115,0
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-
Lettland	Q2 2024	25,0	-	-	-	-	25,0
	Q2 2023	25,0	-	-	-	-	25,0
Österreich	Q2 2024	80,0	-	-	-	-	80,0
	Q2 2023	179,6	-	-	-	-	179,6
Slowakei	Q2 2024	100,0	-	-	-	-	100,0
	Q2 2023	100,0	-	-	-	-	100,0
Slowenien	Q2 2024	50,0	-	-	-	-	50,0
	Q2 2023	50,0	-	-	-	-	50,0
Spanien	Q2 2024	120,4	-	-	-	-	120,4
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-
übrige Staaten/Institutionen	Q2 2024	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	184,6	-	-	184,6	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 b, c und Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die belehnten Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der jeweiligen Forderung beträgt.

		Deckungswerte															Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückständ- igen Leistungen	Gesamt- betrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Summe		davon Wohnwirtschaftlich							Gewerblich									
		Summe							davon									
		Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Mio. €	Mio. €				
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	<b>Q2 2024</b>	<b>19.065,8</b>	<b>3.437,0</b>	<b>249,5</b>	<b>1,5</b>	<b>3.087,9</b>	<b>99,2</b>	<b>-</b>	<b>15.648,7</b>	<b>8.999,1</b>	<b>2.053,0</b>	<b>282,2</b>	<b>3.507,3</b>	<b>707,8</b>	<b>99,4</b>	<b>0,7</b>	<b>-</b>	
	Q2 2023	18.681,1	3.296,1	365,9	2,2	2.804,5	123,5	-	15.385,0	8.799,0	2.092,3	228,5	3.336,9	831,3	96,9			
Deutschland	Q2 2024	8.039,0	2.866,7	249,5	1,5	2.517,6	98,2	-	5.172,3	2.930,1	702,0	68,4	792,0	580,4	99,4			
	Q2 2023	7.854,7	2.803,9	241,2	2,2	2.437,0	123,5	-	5.050,8	2.773,9	734,8	68,9	768,0	608,3	96,9			
Belgien	Q2 2024	18,4	-	-	-	-	-	-	18,4	12,7	-	-	5,7	-	-			
	Q2 2023	12,7	-	-	-	-	-	-	12,7	12,7	-	-	-	-	-			
Finnland	Q2 2024	308,4	72,2	-	-	72,2	-	-	236,1	151,8	84,4	-	-	-	-			
	Q2 2023	202,1	-	-	-	-	-	-	202,1	117,7	84,4	-	-	-	-			
Frankreich	Q2 2024	2.383,4	-	-	-	-	-	-	2.383,4	1.612,8	136,5	47,3	459,4	127,4	-			
	Q2 2023	2.291,9	-	-	-	-	-	-	2.291,9	1.529,8	136,5	51,2	351,4	223,0	-			
Großbritannien	Q2 2024	1.237,1	-	-	-	-	-	-	1.237,1	425,7	213,9	26,5	571,0	-	-			
	Q2 2023	1.536,9	-	-	-	-	-	-	1.536,9	556,4	290,2	26,1	664,2	-	-			
Italien	Q2 2024	78,0	-	-	-	-	-	-	78,0	63,7	-	-	14,3	-	-			
	Q2 2023	51,1	-	-	-	-	-	-	51,1	36,8	-	-	14,3	-	-			
Luxemburg	Q2 2024	46,3	-	-	-	-	-	-	46,3	19,6	-	-	26,8	-	-			
	Q2 2023	46,3	-	-	-	-	-	-	46,3	19,6	-	-	26,8	-	-			
Niederlande	Q2 2024	712,5	168,5	-	-	168,5	-	-	544,0	200,0	41,9	-	302,2	-	-			
	Q2 2023	672,9	168,5	124,7	-	43,8	-	-	504,4	191,0	41,9	-	271,5	-	-			
Österreich	Q2 2024	177,7	-	-	-	-	-	-	177,7	24,3	77,0	-	76,3	-	-			
	Q2 2023	194,1	-	-	-	-	-	-	194,1	51,8	77,0	-	65,3	-	-			
Polen	Q2 2024	1.404,5	-	-	-	-	-	-	1.404,5	556,2	316,0	-	532,2	-	-			
	Q2 2023	1.090,4	-	-	-	-	-	-	1.090,4	439,9	270,5	-	380,0	-	-			
Rumänien	Q2 2024	110,1	-	-	-	-	-	-	110,1	110,1	-	-	-	-	-			
	Q2 2023	110,1	-	-	-	-	-	-	110,1	110,1	-	-	-	-	-			
Schweden	Q2 2024	836,5	114,5	-	-	114,5	-	-	722,0	287,5	184,5	-	250,0	-	-			
	Q2 2023	747,9	86,9	-	-	86,9	-	-	661,0	276,6	147,7	-	236,7	-	-			
Slowakei	Q2 2024	93,4	-	-	-	-	-	-	93,4	-	22,0	-	71,4	-	-			
	Q2 2023	88,4	-	-	-	-	-	-	88,4	-	22,0	-	66,4	-	-			
Slowenien	Q2 2024	45,4	-	-	-	-	-	-	45,4	-	45,4	-	-	-	-			
	Q2 2023	43,9	-	-	-	-	-	-	43,9	-	43,9	-	-	-	-			
Spanien	Q2 2024	311,0	-	-	-	-	-	-	311,0	77,5	88,1	-	145,3	-	-			
	Q2 2023	233,7	-	-	-	-	-	-	233,7	75,3	85,3	-	73,0	-	-			
Tschechien	Q2 2024	428,1	-	-	-	-	-	-	428,1	91,4	92,4	101,9	142,3	-	-			
	Q2 2023	273,9	-	-	-	-	-	-	273,9	91,4	92,4	44,8	45,2	-	-			
Ungarn	Q2 2024	139,5	-	-	-	-	-	-	139,5	78,2	49,0	-	12,4	-	-			
	Q2 2023	139,5	-	-	-	-	-	-	139,5	78,2	49,0	-	12,4	-	-			
Schweiz	Q2 2024	61,2	-	-	-	-	-	-	61,2	61,2	-	-	-	-	-			
	Q2 2023	67,1	-	-	-	-	-	-	67,1	67,1	-	-	-	-	-			
USA	Q2 2024	2.655,5	215,1	-	-	215,1	-	-	2.440,4	2.296,4	-	38,1	105,9	-	-	0,7	-	
	Q2 2023	3.023,8	236,8	-	-	236,8	-	-	2.787,0	2.370,9	16,9	37,5	361,6	-	-			

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

	Q2 2024	Q2 2023
	Mio. €	Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	39,7	48,7
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	101,8	109,5
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	1.169,3	1.171,9
Mehr als 10 Mio. €	17.774,9	17.351,0
<b>Summe</b>	<b>19.085,8</b>	<b>18.681,1</b>

**Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6, 7, 11 bis 15 sowie Abs. 2 Satz 1 Nr. 3 und 4 PfandBG**

**Kennzahlen zu Hypothekendarlehen und dafür verwendeter Deckungswerte**

		Q2 2024	Q2 2023
		Mio. €	Mio. €
<b>Umlaufende Hypothekendarlehen</b>		<b>15.233,3</b>	<b>15.119,9</b>
davon Anteil festverzinslicher Darlehen (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 13)		89,9%	90,0%
<b>Deckungsmasse</b>		<b>19.751,1</b>	<b>19.230,5</b>
davon Gesamtbetrag der Darlehen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 Satz 2 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 11)		-	-
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenzen nach § 19 Abs. 1 Satz 7 überschreiben (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 11)		-	-
Darlehen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*		-	-
Darlehen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 übersteigen (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*		-	-
Darlehen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*		-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 13)		58,0%	57,3%
	CHF	62,6	68,9
	GBP	986,3	513,2
	SEK	488,0	564,3
	USD	547,0	1.329,2
Nettowert nach § 6 Abs. 1 Darlehen- Barwertverordnung je Fremdwährung in Euro § 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Darlehen (seasoning) in Jahren (§ 28 Abs. 2 Nr. 4)		3,7	3,7
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf (§ 28 Abs. 2 Nr. 3)		56,8%	56,0%
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -		35,8%	32,7%
<b>Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6*</b>		<b>Q2 2024</b>	<b>Q2 2023</b>
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a Satz 3 PfandBG für Darlehen (Liquiditätsbedarf)	(Mio €)	-	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1- 180)	-	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a Satz 3 erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio €)	661,6	564,7
<b>Kennzahlen zu Derivaten nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 7</b>		<b>Q2 2024</b>	<b>Q2 2023</b>
		<b>in %</b>	<b>in %</b>
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)		-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)		-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 (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)		-	-
<b>Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 15</b>		<b>Q2 2024</b>	<b>Q2 2023</b>
		<b>in %</b>	<b>in %</b>
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.		1%	0%

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 PfandBG

Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN)

	Q2 2024	Q2 2023
ISIN	DE000A11QAM3, DE000A11QAU6, DE000A11QAX0, DE000A11QAY8, DE000A13SV24, DE000A13SV65, DE000A1RFBQ3, DE000A254ZN3, DE000A2AAV88, DE000A2AAVX2, DE000A2E4Y05, DE000A2E4Y39, DE000A2E4ZA7, DE000A2GSLB8, DE000A2GSLJ1, DE000A2GSLP8, DE000A2GSLQ6, DE000A2GSLV6, DE000A2NB96, DE000A2YNVM8, DE000A2YNVV9, DE000A2YNVY3, DE000A30WF01, DE000A30WF19, DE000A30WF27, DE000A30WF68, DE000A30WF92, DE000A30WFS7, DE000A30WFFU3, DE000A30WFFZ2, DE000A31RJ03, DE000A31RJ11, DE000A31RJ29, DE000A31RJ37, DE000A31RJ45, DE000A31RJ52, DE000A31RJ60, DE000A31RJP3, DE000A31RJS7, DE000A31RJV1, DE000A31RJZ2, DE000A3826W6, DE000A3826X4, DE000A3826Y2, DE000A3E5K73, DE000A3E5K99, DE000A3E5KW9, DE000A3E5KY5, DE000A3E5KZ2, DE000A3TOX48, DE000A3TOX63, DE000A3TOYB8, DE000A3TOYC6, DE000A3TOYD4, DE000A3TOYE2, DE000A3TOYF9, DE000A3TOYG7, DE000A3TOYH5, DE000A3TOYJ1, DE000A3TOYL7, DE000A3TOYM5	DE000A11QA15, DE000A11QA56, DE000A11QAL5, DE000A11QAM3, DE000A11QAQ4, DE000A11QAT8, DE000A11QAU6, DE000A11QAV4, DE000A11QAX0, DE000A11QAY8, DE000A13SV24, DE000A13SV65, DE000A1RFBQ3, DE000A1X3LL4, DE000A1X3LZ4, DE000A254ZN3, DE000A254ZP8, DE000A289PQ3, DE000A2AAV88, DE000A2AAVX2, DE000A2E4Y05, DE000A2E4Y39, DE000A2E4ZA7, DE000A2E4ZD1, DE000A2GSLB8, DE000A2GSLJ1, DE000A2GSL7, DE000A2GSLP8, DE000A2GSLQ6, DE000A2GSLV6, DE000A2LQNP8, DE000A2NB96, DE000A2YNVM8, DE000A2YNVV9, DE000A2YNVY3, DE000A30WF01, DE000A30WF19, DE000A30WF27, DE000A30WF68, DE000A30WF92, DE000A30WFS7, DE000A30WFFU3, DE000A30WFFZ2, DE000A31RJP3, DE000A3E5K73, DE000A3E5K99, DE000A3E5KW9, DE000A3E5KY5, DE000A3E5KZ2, DE000A3H2Z49, DE000A3H2Z80, DE000A3H2ZW1, DE000A3TOX48, DE000A3TOX63, DE000A3TOYB8, DE000A3TOYC6, DE000A3TOYD4, DE000A3TOYE2, DE000A3TOYF9, DE000A3TOYG7, DE000A3TOYH5, DE000A3TOYJ1, DE000A3TOYL7, DE000A3TOYM5

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 1 und 3 PfandBG  
Umlaufende öffentliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

	Nominalwert		Barwert		Risikobarwert	
	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023	Q2 2024	Q2 2023
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen</b>	Mio. €					
Öffentliche Pfandbriefe	7.619,3	8.409,7	7.947,7	8.756,5	7.485,3	7.807,0
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	8.864,1	10.479,8	9.335,6	10.998,0	8.720,6	9.731,8
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
<b>Überdeckung</b>	<b>1.244,8</b>	<b>2.070,0</b>	<b>1.387,9</b>	<b>2.241,5</b>	<b>1.235,3</b>	<b>1.924,8</b>
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	16,3%	24,6%	17,5%	25,6%	16,5%	24,7%
Gesetzliche Überdeckung**	297,4	322,5	159,0	175,1	0,0	0,0
Vertragliche Überdeckung	0,0	0,0	0,0	0,0	0,00	0,0
Freiwillige Überdeckung	947,4	1.747,5	1.228,9	2.066,4	0,0	0,0
Bonitätsdifferenzierungsmodells	1.206,0	2.049,0	1.347,0	2.220,0	-	-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf	15,8%	24,4%	16,9%	25,4%	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4, 5 PfandBG

Laufzeitstruktur der umlaufenden öffentlichen Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen

	Q2 2024		Q2 2023		Q2 2024	Q2 2023
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	FäV (12 Monate)** Pfandbriefumlauf	FäV (12 Monate)** Pfandbriefumlauf
Restlaufzeit:	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
< = 0,5 Jahre	399,4	223,6	303,2	321,3	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	240,9	251,3	255,5	388,0	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	391,5	276,7	398,1	226,6	399,4	303,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	188,0	254,2	239,2	270,9	240,9	255,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.344,5	773,2	708,2	509,9	579,5	637,3
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.069,8	1.200,8	744,5	771,6	1.344,5	708,2
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	330,1	543,0	1.454,4	952,4	1.069,8	744,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.508,2	1.322,9	1.658,6	2.527,3	1.434,6	2.709,1
> 10 Jahre	2.146,8	4.018,4	2.648,0	4.511,8	2.550,6	3.052,0
<b>Summe</b>	<b>7.619,3</b>	<b>8.864,1</b>	<b>8.409,7</b>	<b>10.479,8</b>	<b>7.619,3</b>	<b>8.409,7</b>

\*\*Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um eine äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Insolvenz der Pfandbriefbank zur Geltung kommen könnte.

Informationen zu Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q2 2024 / Q2 2023
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 Absatz 2a	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsunfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsunfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Abs. 2b PfandBG
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 Absatz 2a 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 überschreiben 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 Höchstverschiebedauer von 12 Monaten zu berücksichtigen. Der Sachwalter darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe 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 (*berholverbot). Dies kann dazu führen, dass auch die Fälligkeiten später fällig werdender Emissionen zu verschieben sind, um das Überholverbot zu wahren. Siehe ergänzend auch § 30 Abs. 2a und 2b PfandBG

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 8 und 9 PfandBG

Weitere Deckungswerte für öffentliche Pfandbriefe - Detaildarstellung

		Weitere Deckungswerte für öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 S.1 Nr.2, §20 Abs.2 S.1 Nr. 3a) bis c) und § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4							
		Insgesamt	davon						
			Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 2 (Grundlage § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 8)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 3a) bis c) (Grundlage § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 9)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 4 (Grundlage § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 9)		
			Insgesamt	davon	Insgesamt	davon	Insgesamt	davon	
			gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	<b>Q2 2024</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutschland	Q2 2024	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	Q2 2024	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q2 2024	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 und 3 PfandBG

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der jeweiligen Forderung beträgt.

		Deckungswerte									
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		in dieser Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	<b>Q2 2024</b>	<b>8.864,1</b>	<b>184,8</b>	<b>3.575,0</b>	<b>2.477,7</b>	<b>739,2</b>	<b>1.012,0</b>	<b>659,1</b>	<b>145,6</b>	<b>212,0</b>	<b>43,4</b>
	Q2 2023	10.479,8	179,5	4.124,0	2.946,5	880,2	1.091,0	753,6	394,8	235,8	53,9
Deutschland	Q2 2024	2.184,8	98,6	168,0	1.519,5	9,6	250,0	102,0	83,3	52,4	-
	Q2 2023	3.152,2	69,1	690,1	1.824,2	31,6	274,8	179,1	92,6	59,9	-
Belgien	Q2 2024	66,1	-	-	-	-	-	50,0	16,1	-	-
	Q2 2023	85,0	-	-	-	-	-	50,0	35,0	-	-
Finnland	Q2 2024	13,3	-	-	-	13,3	-	-	-	-	-
	Q2 2023	34,4	-	9,2	-	16,7	8,5	-	-	-	-
Frankreich	Q2 2024	2.114,2	-	137,0	622,3	572,3	531,9	94,3	46,2	110,2	-
	Q2 2023	2.371,1	7,1	150,4	717,1	623,6	602,8	105,2	49,3	122,7	-
Großbritannien	Q2 2024	151,9	-	-	11,8	140,1	-	-	-	-	-
	Q2 2023	155,1	0,7	-	11,7	142,7	-	0,7	-	-	-
Italien	Q2 2024	602,6	-	470,0	128,7	3,9	-	-	-	-	-
	Q2 2023	162,2	-	-	156,6	5,6	-	-	-	-	-
Niederlande	Q2 2024	42,9	42,9	-	-	-	-	42,9	-	0,0	-
	Q2 2023	48,6	48,6	-	-	-	-	48,6	-	0,0	-
Österreich	Q2 2024	3.219,4	-	2.800,0	-	-	-	370,0	-	49,4	-
	Q2 2023	3.766,1	-	3.125,0	-	-	-	370,0	217,9	53,2	-
Portugal	Q2 2024	273,3	-	-	93,3	-	180,0	-	-	-	-
	Q2 2023	286,7	-	-	106,7	-	180,0	-	-	-	-
Spanien	Q2 2024	108,8	-	-	102,1	-	6,7	-	-	-	-
	Q2 2023	150,3	-	-	130,3	-	20,0	-	-	-	-
Japan	Q2 2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	209,3	-	149,3	-	60,0	-	-	-	-	-
Kanada	Q2 2024	43,4	43,4	-	-	-	-	-	-	-	43,4
	Q2 2023	53,9	53,9	-	-	-	-	-	-	-	53,9
Internationale Institutionen	Q2 2024	43,5	-	-	-	-	43,5	-	-	-	-
	Q2 2023	4,9	-	-	-	-	4,9	-	-	-	-

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei öffentlichen Pfandbriefen

als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der jeweiligen Forderung beträgt

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		davon					davon				
		Summe	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige	Summe	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	<b>Q2 2024</b>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q2 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen

	Q2 2024	Q2 2023
	Mio. €	Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	339,1	366,5
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.777,4	3.139,7
Mehr als 100 Mio. €	5.747,6	6.973,5
Summe	8.864,1	10.479,8

**Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6, 7, 11 bis 13, 15 PfandBG**  
**Kennzahlen zu öffentlichen Pfandbriefen und dafür verwendeter Deckungswerte**

	Q2 2024	Q2 2023
	Mio. €	Mio. €
<b>Umlaufende öffentliche Pfandbriefe</b>	<b>7.619,3</b>	<b>8.409,7</b>
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13	72,5%	77,4%
<b>Deckungsmasse</b>	<b>8.864,1</b>	<b>10.479,8</b>
davon Gesamtbetrag der Forderung nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 11)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 3 überschreiten (§ 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12)*	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	74,8%	76,1%
	CAD	13,8
	CHF	38,6
	GBP	187,8
	JPY	183,3
	USD	144,5

**Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6**

		Q2 2024	Q2 2023
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a Satz 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio €)	217,7	141,2
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	180	83
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a Satz 3 erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio €)	542,0	820,3

**Kennzahlen zu Derivaten nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 7**

	Q2 2024	Q2 2023
	in %	in %
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gem. § 19 Abs. 1 Satz 1 Nr. 3 (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 Satz 1 Nr. 15**

	Q2 2024	Q2 2023
	in %	in %
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%

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 PfandBG

Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN)

	Q2 2024	Q2 2023
ISIN	DE0001468361, DE0008119504, DE0008153289, DE000A0B1K04, DE000A11QAR2, DE000A11QAS0, DE000A11QAW2, DE000A12UA83, DE000A13SWG1, DE000A1A6LJ8, DE000A1CR6S0, DE000A1EWJQ9, DE000A1R06C5, DE000A1X2558, DE000A2AAVW4, DE000A31RJX7, DE000A31RJY5	CH0026714276, DE0001468361, DE0008119504, DE0008153289, DE0008217910, DE000A0B1K04, DE000A11QAR2, DE000A11QAS0, DE000A11QAW2, DE000A12UA83, DE000A13SWG1, DE000A1A6LJ8, DE000A1CR6S0, DE000A1EWJQ9, DE000A1R06C5, DE000A1X2558, DE000A1X26J6, DE000A2AAVW4, DE000A3E5K24, DE000A3E5K32