



Report gemäß § 28 PfandBG
Stand: 30.06.2024



Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Hypothekenspfandbriefumlauf

Stichtag	30.06.2024
Referenz	30.06.2023

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1, 3 und 7 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	668,30	646,30	648,29	602,77	615,14	561,47
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	1.271,71	1.118,38	1.267,38	1.069,78	1.170,09	991,06
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	90,29%	73,04%	95,50%	77,48%	90,22%	76,51%
Überdeckung	603,41	472,08	619,10	467,01	554,95	429,59
Gesetzliche Überdeckung **, 1	27,18	26,77	12,97	12,06		
Vertragliche Überdeckung **, 2	0,00	0,00	0,00	0,00		
Freiwillige Überdeckung **, 3	576,22	445,30	606,13	454,96		

§ 28 (1) Nr. 4 und 5 PfandBG Laufzeitstruktur, Zinsbindungsfrist und Fälligkeitsverschiebung	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse		Fälligkeits- verschiebung ***	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
bis zu sechs Monate	80,00	40,00	93,51	150,67	0,00	0,00
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	90,00	38,00	90,05	32,52	0,00	0,00
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	90,00	80,00	89,55	98,24	80,00	40,00
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	101,00	90,00	75,51	83,53	90,00	38,00
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	91,00	141,00	180,33	148,62	191,00	170,00
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	56,50	91,00	144,13	50,03	91,00	141,00
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	53,00	56,50	276,18	147,80	56,50	91,00
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	100,00	93,00	301,03	406,97	128,00	149,50
über 10 Jahre	6,80	16,80	21,42	0,00	31,80	16,80

§ 28 (1) Nr. 5 PfandBG - Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	30.06.2024	30.06.2023
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 (2a) PfandBG	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 Absatz 2b PfandBG.	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 Absatz 2b PfandBG.
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 (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 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.

§ 28 (1) Nr. 6 PfandBG Liqui-Kennzahlen	30.06.2024	30.06.2023
Absolutbetrag der von Null verschiedenen größten sich ergebenden negativen Summe in den nächsten 180 Tagen i.S.d. § 4 (1a) Satz 3 für die Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	9,11	20,21
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	46	63
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 (1a) Satz 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	49,27	35,53
Liquiditätsüberschuss	40,16	15,31

§ 28 (1) Nr. 13 PfandBG Kennzahlen	30.06.2024	30.06.2023
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	90,55%	84,92%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	85,78%	98,45%

[illegible]

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

******, ¹ Die gesetzliche Überdeckungserfordernis 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

******* Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte	30.06.2024	30.06.2023
------------------------------	------------	------------

nach Größenklassen (§ 28 (2) 1a PfandBG)		
bis zu 300 Tsd. €	1,61	1,28
mehr als 300 Tsd. € bis zu 1 Mio. €	20,48	21,88
mehr als 1 Mio. € bis zu 10 Mio. €	456,97	448,10
mehr als 10 Mio. €	739,64	606,61

nach Nutzungsart (I) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)		
wohnwirtschaftlich	21,67	19,01
gewerblich	1.197,04	1.058,86

Weitere Kennzahlen		30.06.2024	30.06.2023
--------------------	--	------------	------------

§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG - Gesamtbetrag der Forderungen nach § 12 (1), die die Grenzen nach § 13 (1) Satz 2 2. Halbsatz PfandBG überschreiten	in Mio. EUR	0,00	0,00
§ 28 (1) Nr. 11 PfandBG - Gesamtbetrag der Werte nach § 19 (1), die die Grenzen nach § 19 (1) Satz 7 überschreiten	in Mio. EUR	0,00	0,00
§ 28 (2) Nr. 4 PfandBG - volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)	in Jahren	4,84	4,87
§ 28 (2) Nr. 3 PfandBG - durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	in %	53,21%	53,04%

Ordentliche Deckung (nominal)	in Mio. EUR	1.218,71	1.077,88
Anteil am Gesamtumlauf	in %	182,36%	166,78%

nach Nutzungsart (II) (§ 28 (2) Nr. 1b und 1c PfandBG)

Staat	Stichtag	Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	Summe
Bundesrepublik Deutschland	30.06.2024	11,89	0,00	6,57	219,44	274,88	0,00	272,38	0,00	0,00	785,16
	30.06.2023	12,34	0,00	6,67	171,64	255,87	0,00	256,17	0,00	0,00	702,70
Frankreich	30.06.2024	0,00	0,00	3,21	264,53	59,13	0,00	106,69	0,00	0,00	433,55
	30.06.2023	0,00	0,00	0,00	266,89	57,29	0,00	50,99	0,00	0,00	375,18
Summe	30.06.2024	11,89	0,00	9,78	483,96	334,01	0,00	379,07	0,00	0,00	1.218,71
	30.06.2023	12,34	0,00	6,67	438,53	313,17	0,00	307,16	0,00	0,00	1.077,88

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 12 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten	Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 2 PfandBG		Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 3 PfandBG		Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 4 PfandBG	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 8, 9 und 10 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Stichtag	Summe	Forderungen i.S.d. § 19 (1) Satz 1 Nr. 2 a) und b) PfandBG		Forderungen gem. § 19 (1) Satz 1 Nr. 3 a) bis c) PfandBG		Forderungen i.S.d. § 19 (1) Nr. 4 PfandBG
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	
Bundesrepublik Deutschland	30.06.2024	53,00	0,00	0,00	0,00	0,00	53,00
	30.06.2023	40,50	0,00	0,00	0,00	0,00	40,50
Summe	30.06.2024	53,00	0,00	0,00	0,00	0,00	53,00
	30.06.2023	40,50	0,00	0,00	0,00	0,00	40,50

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 15 PfandBG	30.06.2024	30.06.2023
Anteil der rückständigen Deckungswerte gemäß Art. 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0,00%	0,00%

§ 28 (2) Nr. 2 PfandBG	Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt	
Staat	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
keine	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00

V) ISIN-Liste der Inhaberpapiere

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG ISIN-Liste nach Pfandbriefgattung (nur Inhaberpandbriefe)	
30.06.2024	30.06.2023
DE000SLB1275	DE000SLB1275
DE000SLB1333	DE000SLB1317
DE000SLB1358	DE000SLB1325
DE000SLB1366	DE000SLB1333
DE000SLB1390	DE000SLB1358
DE000SLB1408	DE000SLB1366
DE000SLB1416	DE000SLB1374
DE000SLB1424	DE000SLB1390
DE000SLB1432	DE000SLB1408
DE000SLB1440	DE000SLB1416
DE000SLB1457	DE000SLB1424
DE000SLB1465	DE000SLB1432
DE000SLB1473	DE000SLB1440
DE000SLB1481	DE000SLB1457
DE000SLB1499	DE000SLB1465
DE000SLB1507	DE000SLB1473
DE000SLB1515	DE000SLB1481
DE000SLB1523	DE000SLB1499
DE000SLB1531	DE000SLB1507
DE000SLB1549	DE000SLB1515
DE000SLB1556	DE000SLB1523
DE000SLB1564	DE000SLB1531

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	30.06.2024
Referenz	30.06.2023

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1, 3 und 7 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	3.839,70	3.288,70	3.653,72	2.954,98	3.112,64	2.521,91
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	4.884,73	4.453,53	4.834,93	4.212,56	4.189,63	3.643,56
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	27,22%	35,42%	32,33%	42,56%	34,60%	44,48%
Überdeckung	1.045,03	1.164,83	1.181,21	1.257,58	1.076,98	1.121,65
Gesetzliche Überdeckung **, 1	154,37	134,78	73,07	59,09		
Vertragliche Überdeckung **, 2	0,00	0,00	0,00	0,00		
Freiwillige Überdeckung **, 3	890,66	1.030,05	1.108,14	1.198,48		

§ 28 (1) Nr. 4 und 5 PfandBG Laufzeitstruktur, Zinsbindungsfrist und Fälligkeitsverschiebung	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse		Fälligkeits- verschiebung ***	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
bis zu sechs Monate	193,00	65,00	223,36	176,19	0,00	0,00
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	175,00	130,00	200,96	181,95	0,00	0,00
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	130,50	193,00	136,11	172,87	193,00	65,00
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	105,00	145,00	200,84	153,15	175,00	130,00
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	65,50	215,50	336,83	309,65	235,50	338,00
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	391,00	65,50	341,83	305,78	65,50	215,50
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	407,50	371,00	268,31	296,06	391,00	65,50
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.599,00	1.467,00	1.308,48	1.142,31	1.472,00	1.745,00
über 10 Jahre	773,20	636,70	1.868,02	1.715,57	1.307,70	729,70

§ 28 (1) Nr. 5 PfandBG - Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	30.06.2024	30.06.2023
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 (2a) PfandBG	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 Verschöbungsöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.	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 Verschöbungsöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe nach § 30 (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 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.

§ 28 (1) Nr. 6 PfandBG Liqui-Kennzahlen	30.06.2024	30.06.2023
Absolutbetrag der von Null verschiedenen größten sich ergebenden negativen Summe in den nächsten 180 Tagen i.S.d. § 4 (1a) Satz 3 für die Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	19,16	26,75
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	85	61
Gesamtbetrag der Deckungswerte welche die Anforderungen von § 4 (1a) Satz 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	101,22	92,82
Liquiditätsüberschuss	82,05	66,06

§ 28 (1) Nr. 13 PfandBG Kennzahlen	30.06.2024	30.06.2023
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	76,10%	77,22%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	98,48%

[illegible]

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

******, ¹ Die gesetzliche Überdeckungserfordernis 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

******* Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs (nominal)	30.06.2024		30.06.2023	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Gesamte Deckungsmasse	4.884,73	127,22%	4.453,53	135,42%
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	4.884,73	127,22%	4.453,53	135,42%
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	108,40	2,82%	108,40	3,30%
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	0,00	0,00%	0,00	0,00%
davon Sichernde Überdeckung nach § 20 (2) Nr. 2, 3 und 4 PfandBG	0,00	0,00%	0,00	0,00%

§ 28 (3) Nr. 1 PfandBG Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	30.06.2024	30.06.2023
bis zu 10 Millionen €	1.259,19	1.161,45
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	3.224,19	2.877,01
mehr als 100 Millionen €	401,35	415,07

Weitere Kennzahlen		30.06.2024	30.06.2023
§ 28 (1) Nr. 11 - Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 (1) und (2), die die Grenzen nach § 20 (3) überschreiten.	in Mio. EUR	0,00	0,00

§ 28 (3) Nr. 2 PfandBG - Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen		Schuldnerklassen		Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		GESAMT	darin enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung
				geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von		
Land													
Bundesrepublik Deutschland	30.06.2024	0,00	0,00	122,67	126,74	2.171,76	201,26	394,40	15,95	3.032,79		0,00	
	30.06.2023	0,00	0,00	172,29	134,98	2.075,07	213,03	209,07	6,19	2.810,63		0,00	
Frankreich	30.06.2024	86,84	0,00	0,00	0,00	1.546,32	12,68	206,10	0,00	1.851,94		0,00	
	30.06.2023	90,19	0,00	0,00	0,00	1.337,89	27,48	187,35	0,00	1.642,90		0,00	
DECKUNGSWERTE, GESAMT	30.06.2024	86,84	0,00	122,67	126,74	3.718,08	213,94	600,50	15,95	4.884,73		0,00	
	30.06.2023	90,19	0,00	172,29	134,98	3.412,96	240,51	396,42	6,19	4.453,53		0,00	

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 12 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten	Forderungen i.S.d. § 20 (2) Nr. 2 PfandBG		Forderungen i.S.d. § 20 (2) Nr. 3 PfandBG	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 8, 9 und 10 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen Staat	Stichtag	Summe	Forderungen i.S.d. § 20 (2) Satz 1 Nr. 2 PfandBG		Forderungen i.S.d. § 20 (2) Satz 1 Nr. 3 a) bis c) PfandBG		Forderungen i.S.d. § 20 (2) Satz 1 Nr. 4 PfandBG	
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013
keine	30.06.2024	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	30.06.2023	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	30.06.2024	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	30.06.2023	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 15 PfandBG Anteil der rückständigen Deckungswerte gemäß Art. 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	30.06.2024	30.06.2023
	0,00%	0,00%

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2024	30.06.2023
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

V) ISIN-Liste der Inhaberpapiere

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG ISIN-Liste nach Pfandbriefgattung (nur Inhaberpfandbriefe)	
30.06.2024	30.06.2023
DE000SLB3917	DE000SLB3263
DE000SLB3958	DE000SLB3271
DE000SLB3974	DE000SLB3917
DE000SLB4SA6	DE000SLB3958
DE000SLB4006	DE000SLB3974
DE000SLB4014	DE000SLB3982
DE000SLB4022	DE000SLB4SA6
DE000SLB4097	DE000SLB4006
DE000SLB4121	DE000SLB4014
DE000SLB4139	DE000SLB4022
DE000SLB4147	DE000SLB4097
DE000SLB4154	DE000SLB4121
DE000SLB4170	DE000SLB4139
DE000SLB4188	DE000SLB4147
DE000SLB4196	DE000SLB4154
DE000SLB4204	DE000SLB4170
DE000SLB4220	DE000SLB4188
DE000SLB4238	DE000SLB4196
DE000SLB4246	DE000SLB4204
DE000SLB4253	DE000SLB4220
DE000SLB4261	DE000SLB4238
DE000SLB4287	DE000SLB4246
DE000SLB4303	DE000SLB4253
DE000SLB4311	DE000SLB4261
DE000SLB4329	DE000SLB4279
DE000SLB4337	DE000SLB4287
DE000SLB4345	DE000SLB4295
DE000SLB4352	DE000SLB4303
DE000SLB4360	DE000SLB4311
	DE000SLB4329
	DE000SLB4337
	DE000SLB4345