

# Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG Öffentliche Pfandbriefe

**3. Quartal 2024**  
**Stichtag: 30.09.2024**

**„Deka**





## Inhaltsverzeichnis

### Veröffentlichung gemäß § 28 PfandBG

	Seite(n)
I. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerte	3
II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	3
III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse	3
IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten	4
V. Laufzeitstruktur	5
VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen	6
VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe	6
VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte	7
IX. Überschreitungen	8
X. Aufteilung der Deckungsmasse - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	9
XI. Aufteilung der Deckungsmasse (direkt geschuldet) - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	10
XII. Aufteilung der Deckungsmasse (gewährleistet) - Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR	11
XIII. Aufteilung der Deckungsmasse (Exportkreditförderung) - Ordentliche Deckung in Mio. EUR	12
XIV. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)	13
XV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)	14
XVI. Kennzahlen zur Liquidität	15
XVII. Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung nach § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG	16

### Zusätzliche freiwillige Angaben

I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse	17-18
II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf	19



## I. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerte

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q3/2024	Q3/2023*	Q3/2024	Q3/2023*
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	2.787,0	3.280,4	2.656,7	2.996,7
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	3.741,5	4.142,7	3.551,7	3.738,1
Überdeckung	954,5	862,3	895,0	741,4
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	34,2 %	26,3 %	33,7 %	24,7 %
Gesetzliche Überdeckung *	110,2	127,8	53,1	59,9
Vertragliche Überdeckung	-	-	-	-
Freiwillige Überdeckung	844,3	734,5	841,8	681,5

\* 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.

## II. vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells in Mio. EUR	Nennwert		Barwert	
	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
Überdeckung nach dem vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell	954,5	862,3	895,0	741,4
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	34,2 %	26,3 %	33,7 %	24,7 %

## III. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Nennwert	
	Q3/2024	Q3/2023
Derivate	0,0	0,0



#### IV. Gesamtbeträge nach Nennwerten und Barwerten

Gesamtbeträge in Mio. EUR	Risikobarwert + 250 BP		Risikobarwert - 250 BP		Risikobarwert Währungsstress	
	Q3/2024	Q3/2023*	Q3/2024	Q3/2023*	Q3/2024	Q3/2023*
Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	2.426,3	2.713,5	2.931,1	3.336,9	2.426,3	2.705,9
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	3.171,9	3.369,9	4.043,7	4.215,8	3.161,0	3.355,2
Überdeckung	745,6	656,5	1.112,6	878,9	734,7	649,3
Überdeckung in Prozent vom Pfandbriefumlauf	30,7 %	24,2 %	38,0 %	26,3 %	30,3 %	24,0 %

Fremdwährungen	Nettobarwert in Fremdwährung (in Mio.)		Wechselkurs		Nettobarwert in Mio. EUR	
	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
USD	78,6	100,0	1,11960	1,05940	70,2	94,4
<b>Gesamtsumme</b>					<b>70,2</b>	<b>94,4</b>

Hinweis: Die Ermittlung des Risikobarwertes erfolgt nach Maßgabe des statischen Ansatzes gemäß PfandBarwertV



## V. Laufzeitstruktur

Laufzeitbänder	Pfandbriefumlauf in Mio. EUR		Deckungsmasse in Mio. EUR		Pfandbriefumlauf bei Fälligkeitsverschiebung von 12 Monate* in Mio. EUR		Pfandbriefumlauf bei Fälligkeitsverschiebung von 12 Monate* in Mio. EUR	
	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023*	Q3/2024	Q3/2023*
<= 6 Monate	275,0	265,0	215,1	344,4	0,0	0,0	0,0	0,0
6 Monate <= 12 Monate	290,0	134,7	58,3	180,6	0,0	0,0	0,0	0,0
12 Monate <= 18 Monate	84,9	274,1	81,6	126,0	275,0	265,0	275,0	265,0
18 Monate <= 2 Jahre	251,0	290,0	133,9	59,9	290,0	134,7	290,0	134,7
2 Jahre <= 3 Jahre	510,0	331,7	386,2	254,9	335,9	564,1	335,9	564,1
3 Jahre <= 4 Jahre	291,0	510,0	521,2	434,2	510,0	331,7	510,0	331,7
4 Jahre <= 5 Jahre	286,5	291,0	224,1	524,5	291,0	510,0	291,0	510,0
5 Jahre <= 10 Jahre	524,5	910,7	992,2	855,9	811,0	1.177,2	811,0	1.177,2
> 10 Jahre	274,1	273,1	1.128,9	1.362,3	274,1	297,6	274,1	297,6
<b>Gesamtsumme</b>	<b>2.787,0</b>	<b>3.280,4</b>	<b>3.741,5</b>	<b>4.142,7</b>	<b>2.787,0</b>	<b>3.280,4</b>	<b>2.787,0</b>	<b>3.280,4</b>

\* 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.

### Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe:

Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe:

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.

Der Sachwalter kann die Fälligkeiten der Tilgungszahlungen verschieben, wenn die maßgeblichen Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG hierfür erfüllt sind. Die Verschiebungsdauer, welche einen Zeitraum von 12 Monaten nicht überschreiten darf, bestimmt der Sachwalter entsprechend der Erforderlichkeit.

Der Sachwalter kann die Fälligkeiten von Tilgungs- und Zinszahlungen, die innerhalb eines Monats nach seiner Ernennung fällig werden, auf das Ende dieses Monatszeitraums verschieben. Entschieden sich der Sachwalter für eine solche Verschiebung, wird das Vorliegen der Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG unwiderlegbar vermutet. Eine solche Verschiebung ist im Rahmen der Höchstverschiebungsdauer von 12 Monaten zu berücksichtigen.

Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

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.



## VI. Aufteilung der Deckungsmasse nach Größenklassen

Gesamtnennwert der Deckungsmasse nach Größenklassen (in Mio. EUR)			Q3/2024	Q3/2023
Ordentliche Deckung	<=	10 Mio. EUR	<b>176,6</b>	158,8
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG				
Ordentliche Deckung	10 Mio. EUR <=	100 Mio. EUR	<b>2.285,8</b>	2.288,8
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG				
Ordentliche Deckung	>	100 Mio. EUR	<b>1.168,1</b>	1.694,1
gem. § 20 Absatz 1 PfandBG				
<b>Summe</b>			<b>3.630,5</b>	4.141,7
Weitere Deckungswerte gem. § 20 Abs. 2 und Werte der barwertigen sichernden Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 S. 3 PfandBG			<b>111,0</b>	1,0
<b>Gesamtsumme</b>			<b>3.741,5</b>	4.142,7

## VII. Anteil der festverzinslichen Deckungswerte und Pfandbriefe

Verhältnis der Gesamtsummen zu den Anteilen festverzinslicher Positionen	Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Nennwert an festverzinslichen Positionen		davon: Prozentualer Anteil an festverzinslichen Positionen	
	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
	Umlauf Öffentliche Pfandbriefe	<b>2.787,0</b>	3.280,4	<b>2.787,0</b>	3.280,4	<b>100,0 %</b>
Deckungsmasse für Öffentliche Pfandbriefe	<b>3.741,5</b>	4.142,7	<b>3.395,8</b>	3.393,6	<b>90,8 %</b>	81,9 %



### VIII. Gesamthöhe weiterer Deckungswerte

Gesamtbetrag der weiteren Deckungswerte gem. § 20 Abs. 2 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2024	Q3/2023
	111,0	1,0

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 Nr. 8 in Verbindung mit § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 PfandBG		Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013	
Sitzland der Schuldner	Code (*)	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
Bundesrepublik Deutschland	DE	110,0	0,0	110,0	0,0
<b>Gesamtsumme</b>		<b>110,0</b>	<b>0,0</b>	<b>110,0</b>	<b>0,0</b>

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S.1 Nr. 9 in Verbindung mit § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) und b) PfandBG		Gesamtbeträge in Mio. EUR		davon: Gedeckte Schuldverschreibungen nach Art. 129 der VO (EU) 575/2013	
Sitzland der Schuldner	Code (*)	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
<b>Gesamtsumme</b>		<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>

Davon weitere Deckungswerte gem. § 28 Abs. 1 S.1 Nr. 9 in Verbindung mit § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4 PfandBG		Gesamtbeträge in Mio. EUR	
Sitzland der Schuldner	Code (*)	Q3/2024	Q3/2023
Bundesrepublik Deutschland	DE	1,0	1,0
<b>Gesamtsumme</b>		<b>1,0</b>	<b>1,0</b>

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



## IX. Überschreitungen

Angaben zu § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11 und 12 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2024	Q3/2023
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG überschreiten	0,0	0,0
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG überschreiten	0,0	0,0
Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 3 PfandBG überschreiten	0,0	0,0

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



## X. Aufteilung der Deckungsmasse Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen	Staat	Regionale Gebiets- körperschaft		Örtliche Gebiets- körperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme		davon: Gewährleis- tungen aus Export- kreditförderung			
		Code (*)	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	
Bundesrepublik Deutschland	DE	<b>67,4</b>	54,8	<b>121,3</b>	400,4	<b>2385,8</b>	2443,5	<b>716,0</b>	761,1	<b>3290,4</b>	3659,8	<b>67,4</b>	54,8
Dänemark	DK	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>97,7</b>	122,2	<b>97,7</b>	122,2	<b>97,7</b>	122,2
Kanada	CA	<b>0,0</b>	0,0	<b>27,3</b>	28,9	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>27,3</b>	28,9	<b>0,0</b>	0,0
Lettland	LV	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>35,5</b>	55,2	<b>0,0</b>	0,0	<b>35,5</b>	55,2	<b>0,0</b>	0,0
Niederlande	NL	<b>50,6</b>	81,7	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>50,6</b>	81,7	<b>50,6</b>	81,7
Norwegen	NO	<b>0,0</b>	12,5	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	12,5	<b>0,0</b>	12,5
Vereinigte Staaten von Amerika	US	<b>32,7</b>	44,3	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>32,7</b>	44,3	<b>32,7</b>	44,3
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	<b>96,3</b>	137,2	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>96,3</b>	137,2	<b>96,3</b>	137,2
<b>Summe</b>		<b>246,9</b>	330,5	<b>148,6</b>	429,3	<b>2.421,2</b>	2.498,7	<b>813,8</b>	883,2	<b>3.630,5</b>	4.141,7	<b>344,7</b>	452,6

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).

Quartalsveröffentlichung per 30.09.2024 für öffentliche Pfandbriefe gemäß § 28 PfandBG



**XI. Aufteilung der Deckungsmasse (direkt geschuldet)  
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der Schuldner	Code (*)	Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme	
		Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
Bundesrepublik Deutschland	DE	<b>0,0</b>	0,0	<b>121,3</b>	400,4	<b>2.385,8</b>	2.443,5	<b>716,0</b>	761,1	<b>3.223,1</b>	3.605,0
Kanada	CA	<b>0,0</b>	0,0	<b>13,0</b>	13,8	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>13,0</b>	13,8
Lettland	LV	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>35,5</b>	55,2	<b>0,0</b>	0,0	<b>35,5</b>	55,2
<b>Summe</b>		<b>0,0</b>	0,0	<b>134,3</b>	414,2	<b>2.421,2</b>	2.498,7	<b>716,0</b>	761,1	<b>3.271,6</b>	3.674,0

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**XII. Aufteilung der Deckungsmasse (gewährleistet)  
Ordentliche Deckung (inkl. sichernde Überdeckung) in Mio. EUR**

Sitzland der gewährleistenden Stellen	Staat	Regionale Gebiets- körperschaft		Örtliche Gebiets- körperschaft		Sonstige Schuldner		Gesamtsumme			
		Code (*)	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	
Bundesrepublik Deutschland	DE	<b>67,4</b>	54,8	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>67,4</b>	54,8
Dänemark	DK	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>97,7</b>	122,2	<b>97,7</b>	122,2
Kanada	CA	<b>0,0</b>	0,0	<b>14,3</b>	15,1	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>14,3</b>	15,1
Niederlande	NL	<b>50,6</b>	81,7	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>50,6</b>	81,7
Norwegen	NO	<b>0,0</b>	12,5	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	12,5
Vereinigte Staaten von Amerika	US	<b>32,7</b>	44,3	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>32,7</b>	44,3
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	<b>96,3</b>	137,2	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>96,3</b>	137,2
<b>Summe</b>		<b>246,9</b>	330,5	<b>14,3</b>	15,1	<b>0,0</b>	0,0	<b>97,7</b>	122,2	<b>359,0</b>	467,7

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



**XIII. Aufteilung der Deckungsmasse (Exportkreditförderung)  
Ordentliche Deckung in Mio. EUR**

Sitzland der gewährleistenden Stellen	Code (*)	Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Sonstige Schuldner	
		Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
Bundesrepublik Deutschland	DE	<b>67,4</b>	54,8	<b>67,4</b>	54,8	<b>0,0</b>	0,0
Dänemark	DK	<b>97,7</b>	122,2	<b>0,0</b>	0,0	<b>97,7</b>	122,2
Niederlande	NL	<b>50,6</b>	81,7	<b>50,6</b>	81,7	<b>0,0</b>	0,0
Norwegen	NO	<b>0,0</b>	12,5	<b>0,0</b>	12,5	<b>0,0</b>	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	<b>32,7</b>	44,3	<b>32,7</b>	44,3	<b>0,0</b>	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	<b>96,3</b>	137,2	<b>96,3</b>	137,2	<b>0,0</b>	0,0
<b>Summe</b>		<b>344,7</b>	452,6	<b>246,9</b>	330,5	<b>97,7</b>	122,2

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



#### XIV. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen (in Mio. EUR)

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen		Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Regionale Gebietskörperschaft		davon: Örtliche Gebietskörperschaft		davon: Sonstige Schuldner	
Land	Code (*)	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
Bundesrepublik Deutschland	DE	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Dänemark	DK	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Kanada	CA	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Lettland	LV	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Niederlande	NL	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Norwegen	NO	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0
<b>Summe</b>		<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0	<b>0,0</b>	0,0

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).

Quartalsveröffentlichung per 30.09.2024 für öffentliche Pfandbriefe gemäß § 28 PfandBG



**XV. Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt (in Mio. EUR)**

Sitzland der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen		Gesamtsumme		davon: Staat		davon: Regionale Gebietskörperschaft		davon: Örtliche Gebietskörperschaft		davon: Sonstige Schuldner	
Land	Code (*)	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023	Q3/2024	Q3/2023
Bundesrepublik Deutschland	DE	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Dänemark	DK	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kanada	CA	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Lettland	LV	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Niederlande	NL	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Norwegen	NO	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigte Staaten von Amerika	US	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Vereinigtes Königreich Großbritannien und Nordirland	GB	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Summe</b>		<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>

(\*) Hinweis: Der Ausweis der Ländercodes basiert auf den zweistelligen ISO-Codes gemäß 'ISO 3166 alpha-2' der Internationalen Organisation für Normung (ISO).



## XVI. Kennzahlen zur Liquidität

Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 N. 6 PfandBG	Gesamtbeträge in Mio. EUR	
	Q3/2024	Q3/2023
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S.3 PfandBG	-31,4	0,0
Am wievielten der nächsten 180 Tage ergibt sich diese größte negative Summe	121	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S.3 PfandBG erfüllen	93,7	163,2

Quartalsveröffentlichung per 30.09.2024 für öffentliche Pfandbriefe gemäß § 28 PfandBG



**XVII. Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung nach § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG**

Q3/2024	Q3/2023
ISIN	ISIN
XS1875412980	XS1875412980
XS2051657463	XS2021499871
XS2332799431	XS2109453691
XS2449929194	XS2366703259
XS2529513850	XS2502402360
	XS2537088598

Q3/2024	Q3/2023
ISIN	ISIN
XS2021499871	XS1952579495
XS2109453691	XS2051657463
XS2366703259	XS2332799431
XS2502402360	XS2449929194
XS2579303780	XS2529513850
	XS2579303780



## I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

		Q3/2024
WAL der Deckungsmasse (Total)	in Jahren	5,8
Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien)	in %	2,0

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q3/2024
EUR		3.678,5
USD		63,0

Aktuelles Pfandbriefrating (gemäß Ratingagentur)	Q3/2024
Moody's	Aaa



## I. Zusätzliche freiwillige Angaben zur Deckungsmasse

<b>Aufteilung der Forderungen gegenüber Zentralbanken und Kreditinstituten i.S.d. § 28 Absatz 1 Nr. 8 und 9 PfandBG nach Bonitätsstufe</b>	<b>in Mio. EUR</b>	<b>Q3/2024</b>
Bonitätsstufe 1		0,0
Bonitätsstufe 2		110,0

<b>Kredite (*)</b>		<b>Q3/2024</b>
Anzahl der Kredite		257
Anzahl der Kreditnehmer		81
Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer	in Mio. EUR	1.460,9
Volumen an Anleihen	in Mio. EUR	332,2
Volumen an Krediten	in Mio. EUR	3.408,3

<b>Derivate</b>		<b>Q3/2024</b>
Sind Derivate in Deckung?	Ja / Nein	Nein
Nettobarwert der Derivate in Deckung	in Mio. EUR	0,0
Typ der Swap-Kontrahenten (I=Intern, E=Extern, B=Beide, N=None)	(I, E, B, N)	N

(\*) Hinweis: Die Berechnungen beziehen sich nur auf Titel der ordentlichen Deckung.

## Quartalsveröffentlichung per 30.09.2024 für öffentliche Pfandbriefe



### II. Zusätzliche freiwillige Angaben zum Umlauf

		Q3/2024
WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)	in Jahren	4,1
Sind Soft Bullet Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Ja
Wenn ja: Ausmaß der Fälligkeitsverschiebung?	in Monaten	12
Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt?	Ja / Nein	Ja
Sind Pass through Strukturen enthalten?	Ja / Nein	Nicht anwendbar (*)

Währungspositionen (nominal)	in Mio. EUR	Q3/2024
EUR		2.787,0

(\*\*) Hinweis: Nicht anwendbar nach derzeitiger Rechtslage.