Informationen zum Öffentlichen Pfandbriefgeschäft gemäß § 28 PfandBG - 3. Quartal 2024

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

PfandBG § 28 (1) Nr. 1, 3 und 7

		Nennwert		Barwert		Risikobarwert [1]	
		Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023
Öffentlicher Pfandbriefumlauf	Mio. €	20,0	-,-	21,4	-,-	19,6	-,-
davon Derivategeschäfte	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Deckungsmasse	Mio. €	420,8	-,-	441,9	-,-	416,7	-,-
davon Derivategeschäfte	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-	-,-
Überdeckung	Mio. €	400,8	-,-	420,6	-,-	397,1	-,-
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		2.004,1	-,-	1.968,4	-,-	2.028,3	-,-
Gesetzliche Überdeckung [2]	Mio. €	1,3	-,-	0,9	-,-		
Vertragliche Überdeckung [3]	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-		
Freiwillige Überdeckung [4]	Mio. €	399,5	-,-	419,7	-,-		

[1] Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 (1) Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

[2] Nennwert: Summe aus der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß $ 4 (2) PfandBG und des Nennwerts der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 (1) PfandBG
Barwert: Barwertige sichernde Überdeckung gemäß § 4 (1) PfandBG

[3] Vertraglich zugesicherte Überdeckung

[4] Residual, in Abhängigkeit der gesetzlichen und vertraglichen Überdeckung; Barwert enthält den Barwert der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 (2) PfandBG

Der Ausweis der Nettobarwerte je Fremdwährung entfällt, da der Deckungsmasse ausschließlich Geschäfte auf Euro-Basis zugrundeliegen.

PfandBG § 28 (1) Nr. 6

		Q3 2024	Q3 2023
Absolutbetrag der von null verschiedenen größten sich ergebenden negativen Summe in den nächsten 180 Tagen i.S.d. § 4 (1a) Satz 3 PfandBG für die Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	Mio. €	-,-	-,-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	(1-180)	-,-	-,-
Gesambetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 (1a) Satz 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätdeckung)	Mio. €	11,0	-,-
Liquiditätsüberschuss	Mio. €	11,0	-,-

PfandBG § 28 (1) Nr. 13

		Q3 2024	Q3 2023
Anteil der festverzinslichen Deckungswerte an der Deckungsmasse	in %	100,0	-,-
Anteil der festverzinslichen Öffentlichen Pfandbriefe an den zu deckenden Verbindlichkeiten	in %	100,0	-,-

PfandBG § 28 (1) Nr. 4 und 5

		Laufzeitenstruktur des Öffentlichen Pfandbriefumlaufs		Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse		Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitstruktur der Öffentlihcen Pfandbriefe/ Verschiebungsszenario: 12 Monate	
		Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023
bis zu sechs Monate	Mio. €	-,-	-,-	16,6	-,-	-,-	-,-
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monate	Mio. €	-,-	-,-	16,6	-,-	-,-	-,-
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monate	Mio. €	-,-	-,-	16,6	-,-	-,-	-,-
mehr als 18 Monate bis zu zwei Jahre	Mio. €	-,-	-,-	16,6	-,-	-,-	-,-
mehr als zwei Jahre bis zu drei Jahre	Mio. €	-,-	-,-	44,2	-,-	-,-	-,-
mehr als drei Jahre bis zu vier Jahre	Mio. €	-,-	-,-	55,2	-,-	-,-	-,-
mehr als vier Jahre bis zu fünf Jahre	Mio. €	-,-	-,-	14,4	-,-	-,-	-,-
mehr als fünf Jahre bis zu zehn Jahre	Mio. €	20,0	-,-	172,6	-,-	-,-	-,-
über zehn Jahre	Mio. €	-,-	-,-	68,0	-,-	20,0	-,-

	Q3 2024/ Q3 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), vorausgesetzt, 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 (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 (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 (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 (2a) und (2b) PfandBG.

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

		Q3 2024	Q3 2023
Deckungsmasse	Mio. €	420,8	-,-
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	Mio. €	420,8	-,-
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	Mio. €	11,0	-,-
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	Mio. €	-,-	-,-
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	Mio. €	-,-	-,-

PfandBG § 28 (3) Nr. 1

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendete Forderungen nach Größengruppen		Q3 2024	Q3 2023
bis zu 10 Mio. EUR	Mio. €	0,0	-,-
mehr als 10 Mio. EUR bis zu 100 Mio. EUR	Mio. €	159,0	-,-
mehr als 100 Mio. EUR	Mio. €	261,8	-,-

PfandBG § 28 (3) Nr. 2

Deckungswerte aus **Deutschland**		Q3 2024	Q3 2023
davon geschuldet von			
Zentralstaat	Mio. €	-,-	-,-
Regionale Gebietskörperschaften	Mio. €	340,8	-,-
Örtliche Gebietskörperschaften	Mio. €	-,-	-,-
Sonstige	Mio. €	80,0	-,-
davon gewährleistet von			
Zentralstaat	Mio. €	-,-	-,-
Regionale Gebietskörperschaften	Mio. €	-,-	-,-
Örtliche Gebietskörperschaften	Mio. €	-,-	-,-
Sonstige	Mio. €	-,-	-,-
Summe	Mio. €	420,8	-,-
darin enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Mio. €	-,-	-,-

PfandBG § 28 (1) Nr. 11

		Q3 2024	Q3 2023
Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 (1) und (2) PfandBG, die die Grenzen nach § 20 (3) PfandBG überschreiten	Mio.€	-,-	-,-

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

PfandBG § 28 (1) Nr. 8, 9 und 10

		Q3 2024	Q3 2023
Forderungen i.S.d. § 20 (2) Satz 1 Nr. 2 PfandBG	Mio. €	-,-	-,-
davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Mio. €	-,-	-,-
Forderungen i.S.d. § 20 (2) Satz 1 Nr. 3 a) bis c) PfandBG	Mio. €	-,-	-,-
davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Mio. €	-,-	-,-
Forderungen i.S.d. § 20 (2) Satz 1 Nr. 4 PfandBG	Mio. €	-,-	-,-
davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Mio. €	-,-	-,-

PfandBG § 28 (1) Nr. 12

		Q3 2024	Q3 2023
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 (2) Nr. 2 PfandBG übersteigen	Mio. €	-,-	-,-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 (2) Nr. 3 PfandBG übersteigen	Mio. €	-,-	-,-

IV) Übersicht - rückständige Leistungen

PfandBG § 28 (1) Nr. 15

		Q3 2024	Q3 2023
Anteil der rückständigen Deckungswerte gem. Art.178 Abs.1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	in %	-,-	-,-

PfandBG § 28 (3) Nr. 3

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	
Deutschland		Q3 2024	Q3 2023	Q3 2024	Q3 2023
Zentralstaat	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-
Regionale Gebietskörperschaften	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-
Örtliche Gebietskörperschaften	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-
Sonstige	Mio. €	-,-	-,-	-,-	-,-

V) ISIN-Liste der Inhaberpapiere

PfandBG § 28 (1) Nr. 2

Q3 2024	Q3 2023
DE000A383GR1	-,-