

# Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

## Hypothekendarlehen

| § 28 (1) S. 1 Nr. 1, 3 und 7 PfandBG<br>  Mio. € | 30.6.2023       |                |                            | 30.6.2022       |                 |                            |
|--|-----------------|----------------|----------------------------|-----------------|-----------------|----------------------------|
|  | Nennwert        | Barwert        | Risikobarwert <sup>1</sup> | Nennwert        | Barwert         | Risikobarwert <sup>1</sup> |
| <b>Deckungsrechnung Hypothekendarlehen</b>       |                 |                |                            |                 |                 |                            |
| Zu deckende Verbindlichkeiten                    | 29 557,5        | 28 307,0       | 26 249,4                   | 23 884,6        | 23 282,3        | 21 412,6                   |
| darunter: Pfandbriefumlauf                       | 29 557,5        | 28 307,0       | 26 249,4                   | 23 884,6        | 23 282,3        | 21 412,6                   |
| darunter: Derivate                               | –               | –              | –                          | –               | –               | –                          |
| Deckungswerte                                    | 41 298,8        | 38 098,5       | 34 173,0                   | 38 413,2        | 37 532,9        | 33 160,7                   |
| darunter: Deckungsdarlehen                       | 39 848,3        | 36 592,5       | 32 801,8                   | 37 315,0        | 36 412,7        | 32 181,8                   |
| darunter: Deckungswerte § 19 (1) PfandBG         | 1 450,5         | 1 506,0        | 1 371,2                    | 1 098,1         | 1 120,2         | 978,8                      |
| darunter: Derivate                               | –               | –              | –                          | –               | –               | –                          |
| Risikobarwert nach Zinsstresstest                |                 |                | 7 923,7                    |                 |                 | 11 748,1                   |
| Abschlag aus Währungsstresstest                  |                 |                | –                          |                 |                 | –                          |
| <b>Überdeckung</b>                               | <b>11 741,3</b> | <b>9 791,5</b> | <b>7 923,7</b>             | <b>14 528,6</b> | <b>14 250,6</b> | <b>11 748,1</b>            |
| <b>Gesetzliche Überdeckung<sup>2</sup></b>       | <b>1 167,1</b>  | <b>1 110,6</b> | <b>1 013,0</b>             | –               | –               | –                          |
| <b>Vertragliche Überdeckung</b>                  | –               | –              | –                          | –               | –               | –                          |
| <b>Freiwillige Überdeckung</b>                   | <b>10 574,2</b> | <b>8 680,8</b> | <b>6 910,7</b>             | –               | –               | –                          |

<sup>1</sup> Risikobarwert inklusive Währungsstresstest.

<sup>2</sup> 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. Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 4 und 5 PfandBG   Mio. €   | 30.6.2023       | 30.6.2022       |
|--|-----------------|-----------------|
| <b>Hypothekendarlehen im Umlauf mit einer Restlaufzeit von</b>                     |                 |                 |
| bis zu sechs Monaten   | 1 625,0         | 1 234,1         |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten  | 1 207,5         | 1 140,0         |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten                                     | 1 022,0         | 1 623,0         |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren                                       | 1 640,0         | 1 207,5         |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren   | 8 921,5         | 2 662,0         |
| mehr als drei bis zu vier Jahren   | 4 425,0         | 6 921,5         |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren   | 1 933,0         | 2 425,0         |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren   | 6 787,0         | 4 895,0         |
| mehr als zehn Jahren   | 1 996,5         | 1 776,5         |
| <b>Gesamt</b>  | <b>29 557,5</b> | <b>23 884,6</b> |
| <b>Deckungswerte Hypothekendarlehen mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von</b> |                 |                 |
| bis zu sechs Monaten   | 1 362,9         | 1 167,4         |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten  | 1 920,7         | 1 634,1         |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten                                     | 1 945,0         | 1 360,4         |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren                                       | 2 110,3         | 2 102,7         |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren   | 4 199,0         | 3 977,2         |
| mehr als drei bis zu vier Jahren   | 4 877,2         | 3 979,9         |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren   | 4 641,3         | 4 669,9         |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren   | 16 868,7        | 16 450,7        |
| mehr als zehn Jahren   | 3 373,6         | 3 070,9         |
| <b>Gesamt</b>  | <b>41 298,8</b> | <b>38 413,2</b> |
| <b>Hypothekendarlehen Fälligkeitsverschiebung (12 Monate)<sup>1,2</sup></b>        |                 |                 |
| bis zu sechs Monaten   | –               | –               |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten  | –               | –               |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten                                     | 1 625,0         | –               |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren                                       | 1 207,5         | –               |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren   | 2 662,0         | –               |
| mehr als drei bis zu vier Jahren   | 8 921,5         | –               |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren   | 4 425,0         | –               |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren   | 6 935,0         | –               |
| mehr als zehn Jahren   | 3 781,5         | –               |
| <b>Gesamt</b>  | <b>29 557,5</b> | –               |

<sup>1</sup> Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um eine äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

<sup>2</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

## 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.

### 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.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 6 PfandBG   Mio. € <sup>1</sup>   | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Absolutbetrag der von Null verschiedenen größten sich ergebenden negativen Summe in den nächsten 180 Tagen i.S.d. § 4 (1a) S. 3 für die Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf) | 1 092,2   | –         |
| Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt   | 152       | –         |
| Gesamtbetrag der Deckungswerte welche die Anforderungen von § 4 (1a) S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)   | 1 328,1   | –         |

<sup>1</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 8, 9 und 10 PfandBG</b><br><b>Weitere Deckungswerte   Mio. €</b>       | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| <b>Forderungen im Sinne des § 19 (1) S. 1 Nr. 2 a) und b) PfandBG</b>                       |                  |                  |
| Deutschland   | –                | –                |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | –                | –                |
| <b>Gesamt</b>   | <b>–</b>         | <b>–</b>         |
| <b>Forderungen im Sinne des § 19 (1) S. 1 Nr. 3 a) bis c) PfandBG</b>                       |                  |                  |
| Deutschland   | –                | –                |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | –                | –                |
| <b>Gesamt</b>   | <b>–</b>         | <b>–</b>         |
| <b>Forderungen im Sinne des § 19 (1) S. 1 Nr. 4 PfandBG</b>                                 |                  |                  |
| Deutschland   | 695,0            | 490,0            |
| Italien   | 655,5            | 338,1            |
| Österreich  | 100,0            | 100,0            |
| Spanien   | –                | 170,0            |
| Gesamt  | 1 450,5          | 1 098,1          |
| <b>Gesamt</b>   | <b>1 450,5</b>   | <b>1 098,1</b>   |

| <b>§ 28 (2) S. 1 Nr. 1 a PfandBG</b><br><b>Größenklassen   Mio. €</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| Bis zu 0,3 Mio. €   | 29 811,6         | 28 297,2         |
| Mehr als 0,3 Mio. € bis zu 1 Mio. €                                   | 7 635,9          | 6 858,1          |
| Mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €                                       | 1 354,3          | 1 229,1          |
| Mehr als 10 Mio. €  | 1 046,5          | 930,6            |
| <b>Gesamt</b>   | <b>39 848,3</b>  | <b>37 315,0</b>  |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 14 PfandBG</b><br><b>Fremdwährung   Mio. €</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| Nettobarwert  | –                | –                |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 13 PfandBG</b><br><b>Zinsstruktur   %</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Anteil festverzinslicher Deckungswerte                         | 98,1             | 98,3             |
| Anteil festverzinslicher Pfandbriefe                           | 76,3             | 77,0             |

| <b>§ 28 (2) S. 1 Nr. 3 und 4 PfandBG</b><br><b>Weitere Strukturdaten</b>         | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %                            | 51,3             | 51,9             |
| Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren | 5,1              | 4,9              |

| § 28 (2) S. 1 Nr. 1 b und c PfandBG<br>Hypothekendarlehen nach Objekt- und<br>Nutzungsart   Mio. € | 30.6.2023    |                    | 30.6.2022    |                    |
|--|--------------|--------------------|--------------|--------------------|
|  | Gewerblich   | Wohnwirtschaftlich | Gewerblich   | Wohnwirtschaftlich |
| <b>Deutschland</b>   |              |                    |              |                    |
| Eigentumswohnungen   | –            | 11 415,0           | –            | 10 615,5           |
| Ein- und Zweifamilienhäuser  | –            | 23 515,0           | –            | 21 936,6           |
| Mehrfamilienhäuser   | –            | 4 061,9            | –            | 3 941,8            |
| Bürogebäude  | 624,0        | –                  | 564,1        | –                  |
| Handelsgebäude   | 173,7        | –                  | 194,7        | –                  |
| Industriegebäude   | 0,0          | –                  | 0,2          | –                  |
| Sonstige gewerbliche Gebäude   | 58,6         | –                  | 62,2         | –                  |
| Unfertige, noch nicht ertragsfähige Neubauten  | –            | 0,1                | –            | 0,0                |
| Bauplätze  | –            | –                  | –            | –                  |
| <b>Gesamt</b>  | <b>856,4</b> | <b>38 992,0</b>    | <b>821,2</b> | <b>36 493,9</b>    |

| § 28 (1) S. 1 Nr. 11 PfandBG<br>Überschreitungen   Mio. €   | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Gesamtbetrag der Forderungen nach §12 (1), die die Grenzen nach § 13 (1) S. 2 2. Halbsatz PfandBG überschreiten | –         | –         |
| Gesamtbetrag der Werte nach § 19 (1), die die Grenzen nach § 19 (1) S. 7 überschreiten                          | –         | –         |

| § 28 (1) S. 1 Nr. 12 PfandBG<br>Überschreitungen   Mio. €     | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Forderungen, die die Grenze nach § 19 (1) Nr. 2 überschreiten | –         | –         |
| Forderungen, die die Grenze nach § 19 (1) Nr. 3 überschreiten | –         | –         |
| Forderungen, die die Grenze nach § 19 (1) Nr. 4 überschreiten | –         | –         |

| § 28 (2) S. 1 Nr. 2 PfandBG<br>Rückständige Leistungen Deutschland   Mio. €                          | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|--|-----------|-----------|
| Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen   | –         | –         |
| Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt | –         | –         |

| § 28 (1) S. 1 Nr. 15 PfandBG<br>Rückständige Leistungen Deutschland   Mio. €   | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|--|-----------|-----------|
| Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt | –         | –         |

**§ 28 (1) S. 1 Nr. 2 PfandBG | Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN)  
nach Pfandbriefgattung<sup>1</sup>**

| 30.6.2023    | 30.6.2022 |
|--------------|-----------|
| DE000CB0HR27 | -         |
| DE000CB0HR43 | -         |
| DE000CB0HR50 | -         |
| DE000CZ40J26 | -         |
| DE000CZ40KZ0 | -         |
| DE000CZ40LG8 | -         |
| DE000CZ40LM6 | -         |
| DE000CZ40LQ7 | -         |
| DE000CZ40MB7 | -         |
| DE000CZ40MH4 | -         |
| DE000CZ40MN2 | -         |
| DE000CZ40MQ5 | -         |
| DE000CZ40MU7 | -         |
| DE000CZ40MV5 | -         |
| DE000CZ40MW3 | -         |
| DE000CZ40NN0 | -         |
| DE000CZ40NP5 | -         |
| DE000CZ40NU5 | -         |
| DE000CZ40NY7 | -         |
| DE000CZ43ZE7 | -         |
| DE000CZ43ZF4 | -         |
| DE000CZ43ZJ6 | -         |
| DE000CZ43ZS7 | -         |
| DE000CZ43ZW9 | -         |
| DE000CZ43ZX7 | -         |
| DE000CZ43Z23 | -         |
| DE000CZ45VF8 | -         |
| DE000CZ45VS1 | -         |
| DE000CZ45WY7 | -         |
| DE000CZ45W08 | -         |
| DE000CZ45W16 | -         |
| DE000CZ45W24 | -         |
| DE000CZ45W32 | -         |
| DE000CZ45W40 | -         |
| DE000CZ45W65 | -         |
| DE000CZ45W73 | -         |
| DE000CZ45W99 | -         |
| DE000EH1A3P2 | -         |

<sup>1</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

## Öffentliche Pfandbriefe

| § 28 (1) S. 1 Nr. 1 ,3 und 7 PfandBG  <br>Mio. € | 30.6.2023      |                |                            | 30.6.2022      |                |                            |
|--|----------------|----------------|----------------------------|----------------|----------------|----------------------------|
|  | Nennwert       | Barwert        | Risikobarwert <sup>1</sup> | Nennwert       | Barwert        | Risikobarwert <sup>1</sup> |
| <b>Deckungsrechnung Öffentliche Pfandbriefe</b>  |                |                |                            |                |                |                            |
| Zu deckende Verbindlichkeiten                    | 9 240,6        | 9 740,5        | 8 974,2                    | 11 819,8       | 12 800,8       | 11 694,9                   |
| darunter: Pfandbriefumlauf                       | 9 240,6        | 9 740,5        | 8 974,2                    | 11 819,8       | 12 800,8       | 11 694,9                   |
| darunter: Derivate                               | –              | –              | –                          | –              | –              | –                          |
| Deckungswerte                                    | 15 193,5       | 15 384,8       | 13 077,4                   | 13 987,4       | 15 481,9       | 12 499,5                   |
| darunter: Darlehen zur Exportfinanzierung        | 2 197,1        | 2 274,5        | 2 160,8                    | 2 543,1        | 2 637,0        | 2 523,2                    |
| darunter: Deckungswerte § 20 (1) PfandBG         | 15 193,5       | 15 384,8       | 13 077,4                   | 13 935,2       | 15 422,1       | 12 449,0                   |
| darunter: Deckungswerte § 20 (2) PfandBG         | –              | –              | –                          | 52,2           | 59,8           | 50,5                       |
| darunter: Derivate                               | –              | –              | –                          | –              | –              | –                          |
| Risikobarwert nach Zinsstresstest                |                |                | 4 379,9                    |                |                | 1 115,4                    |
| Abschlag aus Währungsstresstest                  |                |                | -276,8                     |                |                | -310,9                     |
| <b>Überdeckung</b>                               | <b>5 952,9</b> | <b>5 644,3</b> | <b>4 103,2</b>             | <b>2 167,6</b> | <b>2 681,1</b> | <b>804,5</b>               |
| <b>Gesetzliche Überdeckung<sup>2</sup></b>       | <b>383,0</b>   | <b>382,1</b>   | <b>338,3</b>               | –              | –              | –                          |
| <b>Vertragliche Überdeckung</b>                  | –              | –              | –                          | –              | –              | –                          |
| <b>Freiwillige Überdeckung</b>                   | <b>5 569,9</b> | <b>5 262,3</b> | <b>3 764,9</b>             | –              | –              | –                          |

<sup>1</sup> Risikobarwert inklusive Währungsstresstest.

<sup>2</sup> 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. Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 4 und 5 PfandBG   Mio. €  | 30.6.2023       | 30.6.2022       |
|---|-----------------|-----------------|
| <b>Öffentliche Pfandbriefe im Umlauf mit einer Restlaufzeit von</b>                     |                 |                 |
| bis zu sechs Monaten  | 133,1           | 275,2           |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten   | 1 089,5         | 3 040,0         |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten  | 518,0           | 129,4           |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren  | 2 060,3         | 1 089,5         |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren  | 2 471,1         | 2 577,7         |
| mehr als drei bis zu vier Jahren  | 146,3           | 1 744,7         |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren  | 303,0           | 155,3           |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren  | 1 303,5         | 1 381,1         |
| mehr als zehn Jahren  | 1 215,8         | 1 426,9         |
| <b>Gesamt</b>   | <b>9 240,6</b>  | <b>11 819,8</b> |
| <b>Deckungswerte öffentliche Pfandbriefe mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von</b> |                 |                 |
| bis zu sechs Monaten  | 596,9           | 734,3           |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten   | 772,8           | 795,5           |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten  | 507,8           | 498,6           |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren  | 631,6           | 497,3           |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren  | 1 109,6         | 1 008,9         |
| mehr als drei bis zu vier Jahren  | 1 252,5         | 1 069,8         |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren  | 1 587,1         | 1 146,4         |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren  | 3 393,1         | 3 429,7         |
| mehr als zehn Jahren  | 5 342,1         | 4 806,8         |
| <b>Gesamt</b>   | <b>15 193,5</b> | <b>13 987,4</b> |
| <b>Öffentliche Pfandbriefe Fälligkeitsverschiebung (12 Monate)<sup>1,2</sup></b>        |                 |                 |
| bis zu sechs Monaten  | -               | -               |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten   | -               | -               |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten  | 133,1           | -               |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren  | 1 089,5         | -               |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren  | 2 578,3         | -               |
| mehr als drei bis zu vier Jahren  | 2 471,1         | -               |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren  | 146,3           | -               |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren  | 1 387,3         | -               |
| mehr als zehn Jahren  | 1 435,0         | -               |
| <b>Gesamt</b>   | <b>9 240,6</b>  | <b>-</b>        |

<sup>1</sup> Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um eine äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

<sup>2</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.



## 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.

### 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.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 6 PfandBG   Mio. € <sup>1</sup>   | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Absolutbetrag der von Null verschiedenen größten sich ergebenden negativen Summe in den nächsten 180 Tagen i.S.d. § 4 (1a) S. 3 für die Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf) | 19,2      | –         |
| Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt   | 14        | –         |
| Gesamtbetrag der Deckungswerte welche die Anforderungen von § 4 (1a) S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)   | 848,9     | –         |

<sup>1</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 8 und 9 PfandBG</b><br><b>Weitere Deckungswerte   Mio. €</b>           | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| <b>Forderungen im Sinne des § 20 (2) S. 1 Nr. 2 PfandBG</b>                                 |                  |                  |
| Deutschland   | –                | –                |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | –                | –                |
| <b>Gesamt</b>   | <b>–</b>         | <b>–</b>         |
| <b>Forderungen im Sinne des § 20 (2) S. 1 Nr. 3a) bis c) PfandBG</b>                        |                  |                  |
| Deutschland   | –                | 52,2             |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | –                | –                |
| <b>Gesamt</b>   | <b>–</b>         | <b>52,2</b>      |
| <b>Forderungen im Sinne des § 20 (2) S. 1 Nr. 4 PfandBG</b>                                 |                  |                  |
| Deutschland   | –                | –                |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | –                | –                |
| <b>Gesamt</b>   | <b>–</b>         | <b>–</b>         |
| <b>Gesamt</b>   | <b>–</b>         | <b>52,2</b>      |

| <b>§ 28 (3) Nr. 1 PfandBG</b><br><b>Größenklassen   Mio. €</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Bis zu 10 Mio. €   | 1 914,3          | 1 036,4          |
| Mehr als 10 Mio. € bis zu 100 Mio. €                           | 6 302,6          | 4 369,4          |
| Mehr als 100 Mio. €  | 6 976,6          | 8 529,4          |
| <b>Gesamt</b>  | <b>15 193,5</b>  | <b>13 935,2</b>  |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 14 PfandBG</b><br><b>Fremdwährung   Mio. €</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| Nettobarwert in schweizer Franken                                   | 398,0            | 452,2            |
| Nettobarwert in britischen Pfund                                    | 1 091,2          | 1 460,4          |
| Nettobarwert in US-Dollar   | 882,8            | 1 335,1          |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 13 PfandBG</b><br><b>Zinsstruktur   %</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Anteil festverzinslicher Deckungswerte                         | 78,2             | 72,0             |
| Anteil festverzinslicher Pfandbriefe                           | 52,4             | 38,3             |

| § 28 (3) Nr. 2 PfandBG   Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen   Mio. € | 30.6.2023       | 30.6.2022       |
|--|-----------------|-----------------|
| <b>Gesamt</b>  | <b>15 193,5</b> | <b>13 935,2</b> |
| <b>davon geschuldet von</b>  |                 |                 |
| <b>Staaten</b>   | <b>455,4</b>    | <b>924,3</b>    |
| Griechenland   | -               | 105,0           |
| Island   | -               | 48,1            |
| Italien  | 44,6            | 44,6            |
| Kanada   | 15,8            | 16,6            |
| Österreich   | 395,0           | 325,0           |
| Portugal   | -               | 120,0           |
| Spanien  | -               | 265,0           |
| <b>Regionalen Gebietskörperschaften</b>  | <b>3 812,4</b>  | <b>4 099,9</b>  |
| Deutschland  | 2 773,4         | 2 895,8         |
| Frankreich inklusive Monaco  | 15,0            | 20,3            |
| Italien  | 187,1           | 255,9           |
| Japan  | 42,0            | 42,0            |
| Kanada   | 17,5            | 18,3            |
| Schweiz  | 582,3           | 622,5           |
| Spanien  | 195,1           | 245,1           |
| <b>Örtlichen Gebietskörperschaften</b>   | <b>7 178,7</b>  | <b>5 872,3</b>  |
| Deutschland  | 5 144,6         | 3 547,1         |
| Finnland   | 56,5            | 61,4            |
| Frankreich inklusive Monaco  | 10,1            | 11,9            |
| Großbritannien/Nordirland/Britische Kanalinseln/Insel Man                              | 1 416,8         | 1 538,3         |
| Italien  | 228,3           | 333,0           |
| Schweiz  | 102,2           | 100,4           |
| USA  | 220,3           | 280,1           |
| <b>Sonstigen Schuldner mit Sitz in</b>   | <b>1 386,7</b>  | <b>224,8</b>    |
| Deutschland  | 1 365,7         | 195,0           |
| Großbritannien/Nordirland/Britische Kanalinseln/Insel Man                              | 21,0            | -               |
| USA  | -               | 29,8            |
| <b>Gesamt</b>  | <b>12 833,2</b> | <b>11 121,3</b> |
| <b>davon gewährleistet von</b>   |                 |                 |
| <b>Staaten</b>   | <b>2 303,8</b>  | <b>2 543,1</b>  |
| Deutschland  | 1 601,5         | 1 681,9         |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 1 494,8         | 1 681,9         |
| Belgien  | 7,5             | 38,8            |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 7,5             | 38,8            |
| Dänemark   | 78,8            | 88,6            |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 78,8            | 88,6            |
| Finnland   | 27,6            | 17,9            |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 27,6            | 17,9            |
| Frankreich inkl. Monaco  | 188,5           | 170,1           |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 188,5           | 170,1           |
| Großbritannien / Nordirland Brit.Kanalinseln/Insel Man                                 | 77,0            | 104,6           |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 77,0            | 104,6           |
| Niederlande  | 19,2            | -               |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 19,2            | -               |
| Norwegen   | 39,7            | 44,5            |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 39,7            | 44,5            |
| Österreich   | 6,2             | 22,3            |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 6,2             | 22,3            |
| Schweden   | 1,4             | 8,5             |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 1,4             | 8,5             |
| Schweiz  | 191,5           | 169,6           |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 191,5           | 169,6           |
| Tschechien   | -               | 3,8             |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | -               | 3,8             |
| Internationale Organisationen  | 64,8            | 192,6           |
| davon: Forderungen gegenüber Exportversicherern  | 64,8            | 192,6           |
| <b>Regionalen Gebietskörperschaften</b>  | <b>55,0</b>     | <b>61,4</b>     |
| Belgien  | 55,0            | 61,4            |
| <b>Örtlichen Gebietskörperschaften</b>   | <b>1,5</b>      | <b>-</b>        |
| Großbritannien / Nordirland Brit.Kanalinseln/Insel Man                                 | 1,5             | -               |
| <b>Sonstigen Schuldner</b>   | <b>-</b>        | <b>209,4</b>    |
| Deutschland  | -               | 209,4           |
| <b>Gesamt</b>  | <b>2 360,3</b>  | <b>2 813,9</b>  |
| Deckungswerte § 20 (2) PfandBG   | -               | 52,2            |
| <b>Gesamt</b>  | <b>15 193,5</b> | <b>13 987,4</b> |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 11 PfandBG<br/>Überschreitungen   Mio. €</b>                               | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 (1) und (2), die die Grenzen nach § 20 (3) überschreiten | -                | -                |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 12 PfandBG<br/>Überschreitungen   Mio. €</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| Forderungen, die die Grenze nach § 20 (2) Nr. 2 überschreiten     | -                | -                |
| Forderungen, die die Grenze nach § 20 (2) Nr. 3 überschreiten     | -                | -                |

| <b>§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG<br/>Rückständige Leistungen   Mio. €</b>                                   | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen   | -                | -                |
| Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt | -                | -                |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 15 PfandBG<br/>Rückständige Leistungen Deutschland   Mio. €</b>   | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt | -                | -                |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 2 PfandBG   Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung<sup>1</sup></b> |  |                  |
|---|--|------------------|
| <b>30.6.2023</b>  |  | <b>30.6.2022</b> |
| CH0026096567  |  |                  |
| DE000CB0HR19  |  |                  |
| DE000CZ43Z15  |  |                  |
| DE000CZ45VW3  |  |                  |
| DE000CZ45VX1  |  |                  |
| DE000CZ45V33  |  |                  |
| DE000EH0A1W3  |  |                  |
| DE000HBE1MF6  |  |                  |

<sup>1</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

## Schiffspfandbriefe

Die Commerzbank Aktiengesellschaft hat mit Wirkung zum 31. Mai 2017 die Erlaubnis zum Betreiben des Schiffspfandbriefgeschäfts zurückgegeben. Die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht hat eine Ausnahme von der nach dem § 26 Abs. 1 Nr. 4 Pfandbriefgesetz vorgeschriebenen Begrenzung für weitere Deckungswerte ab 1. Juni 2017 gestattet. Die begebenen

Schiffspfandbriefe sind vollständig durch weitere Deckungswerte besichert, die die Voraussetzungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen und – soweit sie die Begrenzung des Pfandbriefgesetzes für weitere Deckungswerte übersteigen – zusätzliche von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht festgelegte Bonitätskriterien erfüllen.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 1, 3 und 7 PfandBG<br>  Mio. € | 30.6.2023   |             |                            | 30.6.2022   |             |                            |
|--|-------------|-------------|----------------------------|-------------|-------------|----------------------------|
|  | Nennwert    | Barwert     | Risikobarwert <sup>1</sup> | Nennwert    | Barwert     | Risikobarwert <sup>1</sup> |
| <b>Deckungsrechnung</b>                          |             |             |                            |             |             |                            |
| <b>Schiffspfandbriefe</b>                        |             |             |                            |             |             |                            |
| Zu deckende Verbindlichkeiten                    | 59,0        | 60,7        | 57,6                       | 109,0       | 116,7       | 113,1                      |
| darunter: Pfandbriefumlauf                       | 59,0        | 60,7        | 57,6                       | 109,0       | 116,7       | 113,1                      |
| darunter: Derivate                               | –           | –           | –                          | –           | –           | –                          |
| Deckungswerte                                    | 78,5        | 72,7        | 67,6                       | 153,0       | 166,2       | 144,6                      |
| darunter: Deckungsdarlehen                       | –           | –           | –                          | –           | –           | –                          |
| darunter: Deckungswerte<br>§ 26 Abs. (1) PfandBG | 78,5        | 72,7        | 67,6                       | 153,0       | 166,2       | 144,6                      |
| darunter: Derivate                               | –           | –           | –                          | –           | –           | –                          |
| Risikobarwert nach Zinsstresstest                |             |             | 10,0                       |             |             | 31,5                       |
| Abschlag aus Währungsstresstest                  |             |             | –                          |             |             | –                          |
| <b>Überdeckung</b>                               | <b>19,5</b> | <b>12,0</b> | <b>10,0</b>                | <b>44,0</b> | <b>49,5</b> | <b>31,5</b>                |
| <b>Gesetzliche Überdeckung<sup>2</sup></b>       | <b>4,2</b>  | <b>3,9</b>  | <b>3,7</b>                 | –           | –           | –                          |
| <b>Vertragliche Überdeckung</b>                  | –           | –           | –                          | –           | –           | –                          |
| <b>Freiwillige Überdeckung</b>                   | <b>15,3</b> | <b>8,1</b>  | <b>6,3</b>                 | –           | –           | –                          |

<sup>1</sup> Risikobarwert inklusive Währungsstresstest.

<sup>2</sup> 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. Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht..

| § 28 (1) S. 1 Nr. 4 und 5 PfandBG   Mio. €   | 30.6.2023   | 30.6.2022    |
|--|-------------|--------------|
| <b>Schiffspfandbriefe im Umlauf mit einer Restlaufzeit von</b>                     |             |              |
| bis zu sechs Monaten   | 10,0        | 50,0         |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten  | –           | –            |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten                                     | 5,0         | 10,0         |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren                                       | –           | –            |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren   | 44,0        | 5,0          |
| mehr als drei bis zu vier Jahren   | –           | 44,0         |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren   | –           | –            |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren   | –           | –            |
| mehr als zehn Jahren   | –           | –            |
| <b>Gesamt</b>  | <b>59,0</b> | <b>109,0</b> |
| <b>Deckungswerte Schiffspfandbriefe mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von</b> |             |              |
| bis zu sechs Monaten   | 7,0         | –            |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten  | –           | –            |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten                                     | –           | –            |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren                                       | –           | 5,0          |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren   | 57,0        | –            |
| mehr als drei bis zu vier Jahren   | –           | 39,0         |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren   | 14,5        | –            |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren   | –           | 109,0        |
| mehr als zehn Jahren   | –           | –            |
| <b>Gesamt</b>  | <b>78,5</b> | <b>153,0</b> |
| <b>Schiffspfandbriefe Fälligkeitsverschiebung (12 Monate)<sup>1,2</sup></b>        |             |              |
| bis zu sechs Monaten   | –           | –            |
| mehr als sechs Monaten bis zu zwölf Monaten  | –           | –            |
| mehr als zwölf Monaten bis zu achtzehn Monaten                                     | 10,0        | –            |
| mehr als achtzehn Monaten bis zu zwei Jahren                                       | –           | –            |
| mehr als zwei bis zu drei Jahren   | 5,0         | –            |
| mehr als drei bis zu vier Jahren   | 44,0        | –            |
| mehr als vier bis zu fünf Jahren   | –           | –            |
| mehr als fünf bis zu zehn Jahren   | –           | –            |
| mehr als zehn Jahren   | –           | –            |
| <b>Gesamt</b>  | <b>59,0</b> | –            |

<sup>1</sup> Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um eine äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

<sup>2</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

## 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.

### 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.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 6 PfandBG   Mio. € <sup>1</sup>   | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Absolutbetrag der von Null verschiedenen größten sich ergebenden negativen Summe in den nächsten 180 Tagen i.S.d. § 4 (1a) S. 3 für die Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf) | 12,3      | –         |
| Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt   | 152       | –         |
| Gesamtbetrag der Deckungswerte welche die Anforderungen von § 4 (1a) S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)   | 72,8      | –         |

<sup>1</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

| § 28 (1) S. 1 Nr. 8, 9 und 10 PfandBG<br>Weitere Deckungswerte   Mio. €                     | 30.6.2023   | 30.6.2022    |
|---|-------------|--------------|
| <b>Forderungen gemäß § 26 (1) S. 1 Nr. 3 PfandBG</b>  |             |              |
| Deutschland   | -           | -            |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | -           | -            |
| <b>Gesamt</b>   | -           | -            |
| <b>Forderungen gemäß § 26 (1) S. 1 Nr. 4 PfandBG</b>  |             |              |
| Deutschland   | -           | -            |
| darunter: gedeckte Schuldverschreibungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | -           | -            |
| <b>Gesamt</b>   | -           | -            |
| <b>Forderungen gemäß § 26 (2) S. 1 Nr. 5 PfandBG</b>  |             |              |
| Deutschland   | 71,5        | 39,0         |
| Österreich  | -           | 109,0        |
| Portugal  | -           | 5,0          |
| Slowakei  | 7,0         | -            |
| <b>Gesamt</b>   | <b>78,5</b> | <b>153,0</b> |
| <b>Gesamt</b>   | <b>78,5</b> | <b>153,0</b> |

| § 28 (4) S. 1 Nr. 1 a<br>Größenklassen   Mio. € | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Bis zu 0,5 Mio. €                               | -         | -         |
| Mehr als 0,5 Mio. € bis zu 5 Mio. €             | -         | -         |
| Mehr als 5 Mio. €                               | -         | -         |
| <b>Gesamt</b>                                   | -         | -         |

| § 28 (1) S. 1 Nr. 14 PfandBG<br>Fremdwährung   Mio. € | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| Nettobarwert in schweizer Franken                     | -         | -         |
| Nettobarwert in japanischen Yen                       | -         | -         |
| Nettobarwert in US-Dollar                             | -         | -         |
| <b>Gesamt</b>   | -         | -         |

| § 28 (1) S. 1 Nr. 13 PfandBG<br>Zinsstruktur   % | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|--|-----------|-----------|
| Anteil festverzinslicher Deckungswerte           | 100,0     | 100,0     |
| Anteil festverzinslicher Pfandbriefe             | 100,0     | 100,0     |

| § 28 (4) S. 1 Nr. 1 b PfandBG<br>Registerland der beliebigen Schiffe und Schiffsbauwerke   Mio. € | 30.6.2023 | 30.6.2022 |
|---|-----------|-----------|
| <b>Seeschiffe</b>   | -         | -         |
| <b>Binnenschiffe</b>  | -         | -         |
| <b>Gesamt</b>   | -         | -         |



| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 11 PfandBG<br/>Überschreitungen   Mio. €</b>  | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|--|------------------|------------------|
| Gesamtbetrag der Schiffshypotheken nach § 21 PfandBG, die die Grenzen nach § 22 (5) S. 2 PfandBG überschreiten | –                | –                |
| Gesamtbetrag der Werte nach § 26 (1), die die Grenzen nach § 26 (1) S. 6 PfandBG überschreiten                 | –                | –                |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 12 PfandBG<br/>Überschreitungen   Mio. €</b> | <b>30.6.2023</b> | <b>30.6.2022</b> |
|---|------------------|------------------|
| Forderungen, die die Grenze nach § 26 (1) Nr. 3 überschreiten     | –                | –                |
| Forderungen, die die Grenze nach § 26 (1) Nr. 4 überschreiten     | –                | –                |
| Forderungen, die die Grenze nach § 26 (1) Nr. 5 überschreiten     | –                | –                |

| <b>§ 28 (1) S. 1 Nr. 2 PfandBG   Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung<sup>1</sup></b> |  | <b>30.6.2022</b> |
|---|--|------------------|
| <b>30.6.2023</b>  |  |                  |
| –   |  | –                |
| –   |  | –                |
| –   |  | –                |

<sup>1</sup> Die Vorjahresdaten werden gemäß § 55 PfandBG erst ab Q3 2023 veröffentlicht.

## Rückständige Leistungen

Der Nennwert der zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendeten Darlehensforderungen betrug 0,0 Mio. Euro; infolgedessen gab es auch keine rückständigen Leistungen.

Im Vorjahr betrug der Nennwert der zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendeten Darlehensforderungen ebenfalls 0,0 Mio. Euro. Rückständige Leistungen von Tilgung und Zinsen waren hierin nicht enthalten, da fällige Tilgungsleistungen ab dem Fälligkeitszeitpunkt nicht mehr in der Deckungsrechnung und Zinsen nicht als Deckungswert zu berücksichtigen waren.

Die rückständigen Leistungen über den Deckungsbetrag hinaus betrugen im Vorjahr 0,0 Mio. Euro. Der Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung betrug, lag im Vorjahr bei 0,0 Mio. Euro.