



Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €)

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	1.788,9	1.533,0	255,9
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.564,8	2.003,5	561,3
davon Derivate	58,6	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.360,0	1.894,9	465,1

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.242,9	2.073,6	169,3
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.096,2	2.620,9	475,3
davon Derivate	82,2	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.848,6	2.506,2	342,4

¹⁾ dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €) nach vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	1.788,9	1.533,0	255,9
Barwert	2.564,8	2.003,5	561,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.242,9	2.073,6	169,3
Barwert	3.096,2	2.620,9	475,3

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾
bis zu 6 Monate	51,0	45,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	96,4	94,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	28,6	27,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	116,5	114,4
mehr als 2 bis 3 Jahre	187,7	183,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	129,9	95,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	40,5	253,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	265,9	423,9
mehr als 10 Jahre	872,4	296,3
Total	1.788,9	1.533,0

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	162,7	314,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	79,6	226,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	48,1	45,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	101,5	94,0
mehr als 2 bis 3 Jahre	184,9	141,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	243,8	183,4
mehr als 4 bis 5 Jahre	129,6	95,1
mehr als 5 bis 10 Jahre	339,8	670,4
mehr als 10 Jahre	952,9	303,1
Total	2.242,9	2.073,6

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio. €)

§28 Abs. 3 Nr. 1

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	187,5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	459,7
mehr als 100 Mio.€	1.126,7
Total	1.773,9

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs.5 (Mio. €)

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	193,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	647,4
mehr als 100 Mio.€	1.371,8
Total	2.212,9

Verteilung der nennwertig als Deckung für Öffentliche Pfandbriefe verwendeten Forderungen auf die einzelnen Staaten, in denen der Schuldner bzw. die gewährleistende Stelle ihren Sitz hat - aufgeschlüsselt nach §28 Abs. 3 Nr. 2 (Mio. €)

§28 Abs. 3 Nr. 2

Länder	Gesamt	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.400,9	-	-	1.067,1	279,7	27,9	0,1	1,4	24,60	0,1
EU-Institutionen	40,0	-	-	-	-	-	40,0	-	-	-
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	225,0	-	200,0	25,0	-	-	-	-	-	-
Spanien	83,0	-	15,0	50,0	-	18,0	-	-	-	-
Total	1.773,9	0,0	220,0	1.142,1	299,7	45,9	40,1	1,4	24,6	0,1

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Länder	Gesamt	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.467,5	-	-	1.110,4	303,4	22,9	0,1	1,7	28,9	0,1
EU-Institutionen	5,0	-	-	-	-	-	5,0	-	-	-
Frankreich	25,4	-	-	-	0,4	-	25,0	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	295,0	-	200,0	25,0	-	-	70,0	-	-	-
Portugal	35,0	-	35,0	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	315,0	-	155,0	130,0	5,0	25,0	-	-	-	-
Total	2.212,9	0,0	440,0	1.265,4	328,8	47,9	100,1	1,7	28,9	0,1

Weitere Deckungswerte gemäß §28 Abs. 1 Nr. 4 und 5 - Detaildarstellung (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 1	Geldforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.D. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Österreich	-	15,0	0,0	15,0
Total	-	15,0	-	15,0

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 1	Geldforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 2	Gesamt
Deutschland	-	15,0	15,0
Österreich	-	15,0	15,0
Total	-	30,0	30,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe⁽¹⁾			1.533,0	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			84,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.788,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			465,1	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Umlaufende Pfandbriefe⁽²⁾			2.073,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			81,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.242,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CHF			1,3	Mio. €
EUR			341,3	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.

⁽¹⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0,0 Mio. €

⁽²⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0,0 Mio. €

⁽³⁾ - dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO