



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	2.284,0	1.958,3	325,7
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.918,8	2.481,9	436,9
davon Derivate	113,2	-	
Risikobarwert *)	2.727,2	2.349,1	378,1

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

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.295,3	1.968,6	326,7
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.962,5	2.553,3	409,2
davon Derivate	137,3	-	
Risikobarwert *)	2.762,6	2.409,5	353,1

*) 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	Überdeckung
Nennwert	2.284,0	1.958,3	325,7
Barwert	2.918,8	2.481,9	436,9

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.295,3	1.968,6	326,7
Barwert	2.962,5	2.553,3	409,2

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf
bis zu 6 Monate	230,4	273,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	184,6	80,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	105,5	114,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	76,0	20,4
mehr als 2 bis 3 Jahre	231,0	185,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	115,0	111,2
mehr als 4 bis 5 Jahre	280,4	141,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	361,9	677,7
mehr als 10 Jahre	699,2	355,1
Total	2.284,0	1.958,3

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	1,9	50,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	101,7	213,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	146,7	272,9
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	256,6	68,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	232,1	118,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	157,9	115,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	113,2	25,2
mehr als 5 bis 10 Jahre	609,2	595,3
mehr als 10 Jahre	676,0	508,8
Total	2.295,3	1.968,6

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. €	265,1
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	911,8
mehr als 100 Mio.€	1.107,1
Total	2.284,0

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	52,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	684,1
mehr als 100 Mio.€	1.559,0
Total	2.295,3

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	1.880,1	-	2,0	1.184,3	375,3	195,7	0,2	5,8	95,5	21,3
EU-Institutionen	103,9	-	-	-	-	-	103,9	-	-	-
Frankreich	1,0	-	-	-	1,0	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	100,0	-	75,0	25,0	-	-	-	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	2.284,0	-	141,0	1.324,3	396,3	195,7	104,1	5,8	95,5	21,3

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	1.789,7	-	2,0	1.441,5	-	293,6	0,2	4,6	25,1	22,7
EU-Institutionen	149,9	-	-	-	-	-	149,9	-	-	-
Frankreich	56,7	-	55,0	-	1,7	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	100,0	-	75,0	25,0	-	-	-	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	2.295,3	-	196,0	1.581,5	21,7	293,6	150,1	4,6	25,1	22,7

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	
Deutschland		30		30,00
Total		30,0		30,00

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

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	
Total				

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe			1.958,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			81,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.284,0	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			86,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			54,5	Mio. €
EUR			329,2	Mio. €
GBP			-0,1	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe			1.968,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.295,3	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
EUR			353,2	Mio. €
GBP			-0,1	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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