



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	1.886,9	1.619,2	267,7
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.518,0	2.107,7	410,3
davon Derivate	114,8	-	
Risikobarwert *)	2.331,3	1.987,9	343,4

*) 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	2.410,0	2.065,1	344,9
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.076,8	2.603,0	473,8
davon Derivate	117,6	-	
Risikobarwert *)	2.876,0	2.464,7	411,3

*) 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	1.886,9	1.619,2	267,7
Barwert	2.518,0	2.107,7	410,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.410,0	2.065,1	344,9
Barwert	3.076,8	2.603,0	473,8

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	85,1	81,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	98,5	59,7
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	75,6	117,6
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	29,3	51,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	209,3	138,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	179,7	131,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	173,3	183,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	343,4	546,2
mehr als 10 Jahre	692,7	309,9
Total	1.886,9	1.619,2

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	164,3	123,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	293,5	322,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	60,4	81,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	146,6	59,7
mehr als 2 bis 3 Jahre	192,2	168,6
mehr als 3 bis 4 Jahre	204,7	138,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	181,6	131,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	392,7	648,6
mehr als 10 Jahre	774,0	391,0
Total	2.410,0	2.065,1

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. €	204,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	787,5
mehr als 100 Mio. €	894,7
Total	1.886,9

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	266,5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	940,0
mehr als 100 Mio. €	1.203,5
Total	2.410,0

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	1.419,7	-	-	940,2	335,5	58,0	0,2	2,1	83,7	-
EU-Institutionen	81,4	-	-	-	-	-	81,4	-	-	-
Frankreich	25,8	-	25,0	-	0,8	-	-	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	175,0	-	100,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	1.886,9	-	175,0	1.080,2	356,3	58,0	131,6	2,1	83,7	0,0

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	1.990,8	-	2,0	1.255,7	383,9	224,5	0,2	5,9	97,3	21,3
EU-Institutionen	118,9	-	-	-	-	-	118,9	-	-	-
Frankreich	1,3	-	-	-	1,3	-	-	-	-	-
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	2.410,0	-	141,0	1.395,7	405,2	224,5	119,1	5,9	97,3	21,3

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	
Total				

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	
Deutschland		35,0		35,00
Total	0,0	35,0	0,0	35,00

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe			1.619,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.886,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			54,6	Mio. €
EUR			294,3	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe			2.065,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			79,5	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.410,0	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			87,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			55,6	Mio. €
EUR			361,4	
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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