



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
<b>Nennwert</b>	2.477,0	2.120,5	<b>356,5</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	3.366,0	2.864,7	<b>501,3</b>
davon Derivate	148,4	-	
<b>Risikobarwert *)</b>	3.170,6	2.772,3	<b>398,3</b>

\*) 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
<b>Nennwert</b>	2.391,9	2.061,2	<b>330,7</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	3.252,3	2.811,9	<b>440,4</b>
davon Derivate	137,5	-	
<b>Risikobarwert *)</b>	3.252,2	2.811,9	440,3

\*) 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
<b>Nennwert</b>	2.477,0	2.120,5	<b>356,5</b>
<b>Barwert</b>	3.366,0	2.864,7	<b>501,3</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	2.391,9	2.061,2	<b>330,7</b>
<b>Barwert</b>	3.252,3	2.811,9	<b>440,4</b>

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	106,8	77,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	54,5	49,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1,6	50,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	101,7	213,9
mehr als 2 bis 3 Jahre	392,8	336,0
mehr als 3 bis 4 Jahre	155,1	118,4
mehr als 4 bis 5 Jahre	191,8	125,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	628,3	601,0
mehr als 10 Jahre	844,4	548,3
<b>Total</b>	<b>2.477,0</b>	<b>2.120,5</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	78,4	43,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	81,1	48,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	100,2	77,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	53,6	40,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	159,8	220,0
mehr als 3 bis 4 Jahre	321,8	299,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	174,1	93,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	609,7	555,0
mehr als 10 Jahre	813,2	683,3
<b>Total</b>	<b>2.391,9</b>	<b>2.061,2</b>

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. €	48,8
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	708,6
mehr als 100 Mio. €	1.719,6
<b>Total</b>	<b>2.477,0</b>

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	1.970,5	-	108,0	1.420,0	2,6	374,7	7,0	4,9	29,3	24,0
EU-Institutionen	149,9	-	-	-	-	-	149,9	-	-	-
Frankreich	57,6	-	55,0	-	2,6	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2.477,0</b>	<b>-</b>	<b>302,0</b>	<b>1.560,0</b>	<b>25,2</b>	<b>374,7</b>	<b>156,9</b>	<b>4,9</b>	<b>29,3</b>	<b>24,0</b>

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

Länder	Staat Vorjahr	Gebietskörperschaft		Sonstige	Gesamt
		regionale	örtliche		
Deutschland	12,2	1.399,0	18,2	327,9	1.757,3
EU-Institutionen	-	-	-	106,4	106,4
Frankreich	55,0	-	-	-	55,0
Italien	39,0	-	-	-	39,0
Japan	-	-	20,0	-	20,0
Österreich	224,2	25,0	-	25,0	274,2
Polen	25,0	-	-	-	25,0
Spanien	-	115,0	-	-	115,0
<b>Total</b>	<b>355,4</b>	<b>1.539,0</b>	<b>38,2</b>	<b>459,3</b>	<b>2.391,9</b>

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	
				-
				-
<b>Total</b>				-

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	
				-
				-
<b>Total</b>				-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>			2.120,5	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			77,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			2.477,0	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
EUR			398,4	Mio. €
GBP			-0,1	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b>			2.061,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			2.391,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			82,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
EUR			440,3	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.