



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	1.964,1	1.685,4	278,7
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.565,3	2.154,3	411,0
davon Derivate	100,5	-	
Risikobarwert *)	2.378,5	2.032,3	346,2

*) 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	2.577,5	2.212,4	365,1
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.279,1	2.779,2	499,9
davon Derivate	127,4	-	
Risikobarwert *)	3.069,5	2.635,1	434,4

*) 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	1.964,1	1.685,4	278,7
Barwert	2.565,3	2.154,3	411,0

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.577,5	2.212,4	365,1
Barwert	3.279,1	2.779,2	499,9

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	170,8	80,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	48,5	114,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	71,9	20,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	98,3	128,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	124,4	168,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	114,0	40,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	289,7	213,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	349,9	612,1
mehr als 10 Jahre	696,6	308,1
Total	1.964,1	1.685,4

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	193,3	254,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	223,6	272,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	187,5	80,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	128,5	114,0
mehr als 2 bis 3 Jahre	209,8	148,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	175,6	168,4
mehr als 4 bis 5 Jahre	169,7	40,1
mehr als 5 bis 10 Jahre	500,3	744,8
mehr als 10 Jahre	789,2	389,2
Total	2.577,5	2.212,4

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. €	229,6
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	850,8
mehr als 100 Mio.€	883,7
Total	1.964,1

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	275,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	1.063,8
mehr als 100 Mio.€	1.238,5
Total	2.577,5

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	1.422,4	-	2,0	932,0	348,5	20,7	0,2	4,0	94,3	20,7
EU-Institutionen	91,9	-	-	-	-	-	91,9	-	-	-
Frankreich	75,8	-	75,0	-	0,8	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
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	1.964,1	-	241,0	1.072,0	369,3	20,7	142,1	4,0	94,3	20,7

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	2.091,8	-	2,0	1.234,3	408,1	316,9	0,2	6,1	102,2	22,0
EU-Institutionen	130,4	-	-	-	-	-	130,4	-	-	-
Frankreich	56,3	-	55,0	-	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	2.577,5	-	196,0	1.374,3	429,4	316,9	130,6	6,1	102,2	22,0

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			1.685,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			77,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.964,1	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			55,2	Mio. €
EUR			296,7	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe			2.212,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			79,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.577,5	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			57,6	Mio. €
EUR			382,8	
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.