



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

|                         | Deckungsmasse | Pfandbriefe im Umlauf | Überdeckung  |
|-------------------------|---------------|-----------------------|--------------|
| <b>Nennwert</b>         | 3.195,4       | 2.840,4               | <b>355,0</b> |
| <b>Barwert</b>          | 3.490,2       | 3.161,1               | <b>329,2</b> |
| <b>davon Derivate</b>   | 82,5          | -                     |              |
| <b>Risikobarwert )*</b> | 3.947,9       | 3.769,7               | <b>178,3</b> |

**Anteil weitere Deckungswerte (Stichtag)**

|                                  |            |
|----------------------------------|------------|
| Geldforderungen §20 Abs. 2 Nr. 2 | <b>0,0</b> |
|----------------------------------|------------|

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

**Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5**

|                         | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr | Überdeckung Vorjahr |
|-------------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------|
| <b>Nennwert</b>         | 3.305,6               | 2.975,3                       | <b>330,4</b>        |
| <b>Barwert</b>          | 3.297,3               | 2.963,1                       | <b>334,2</b>        |
| <b>davon Derivate</b>   | 2,1                   | 18,1                          |                     |
| <b>Risikobarwert )*</b> | 3.562,1               | 3.260,1                       | <b>302,1</b>        |

**Anteil weitere Deckungswerte (Vorjahr)**

|                                  |            |
|----------------------------------|------------|
| Geldforderungen §20 Abs. 2 Nr. 2 | <b>4,3</b> |
|----------------------------------|------------|

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

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

| Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur | Deckungsmasse  | Pfandbriefe im Umlauf |
|--|----------------|-----------------------|
| bis 1 Jahr                             | 137,9          | 133,3                 |
| mehr als 1 bis 2 Jahre                 | 127,0          | 78,5                  |
| mehr als 2 bis 3 Jahre                 | 115,1          | 154,2                 |
| mehr als 3 bis 4 Jahre                 | 373,4          | 379,7                 |
| mehr als 4 bis 5 Jahre                 | 143,7          | 344,3                 |
| mehr als 5 bis 10 Jahre                | 645,6          | 745,5                 |
| mehr als 10 Jahre                      | 1.652,8        | 1.004,8               |
| <b>Gesamt</b>                          | <b>3.195,4</b> | <b>2.840,4</b>        |

**Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5**

| Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr |
|--|-----------------------|-------------------------------|
| bis 1 Jahr                             | 240,5                 | 223,7                         |
| mehr als 1 bis 2 Jahre                 | 105,9                 | 138,8                         |
| mehr als 2 bis 3 Jahre                 | 124,1                 | 78,5                          |
| mehr als 3 bis 4 Jahre                 | 137,9                 | 153,5                         |
| mehr als 4 bis 5 Jahre                 | 271,3                 | 394,6                         |
| mehr als 5 bis 10 Jahre                | 649,0                 | 974,1                         |
| mehr als 10 Jahre                      | 1.776,9               | 1.012,1                       |
| <b>Gesamt</b>                          | <b>3.305,6</b>        | <b>2.975,3</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 III Nr. 1 (Mio. €)**

| Länder         | Staat        | Gebietskörperschaft |             | Sonstige    | Gesamt         |
|----------------|--------------|---------------------|-------------|-------------|----------------|
|                |              | regionale           | örtliche    |             |                |
| Deutschland    | 149,8        | 2.157,7             | 40,6        | 32,7        | <b>2.380,8</b> |
| Italien        | 89,0         | -                   | -           | -           | <b>89,0</b>    |
| Frankreich     | 65,0         | -                   | -           | 11,4        | <b>76,4</b>    |
| Großbritannien | -            | -                   | -           | 7,5         | <b>7,5</b>     |
| Irland         | 25,0         | -                   | -           | -           | <b>25,0</b>    |
| Österreich     | 195,2        | 25,0                | -           | -           | <b>220,2</b>   |
| Spanien        | -            | 148,5               | 35,0        | -           | <b>183,5</b>   |
| Niederlande    | 25,0         | -                   | -           | -           | <b>25,0</b>    |
| Ungarn         | 25,0         | -                   | -           | -           | <b>25,0</b>    |
| Japan          | 50,0         | -                   | 20,0        | -           | <b>70,0</b>    |
| Luxemburg      | -            | -                   | -           | 38,0        | <b>38,0</b>    |
| Portugal       | 25,0         | 30,0                | -           | -           | <b>55,0</b>    |
| <b>Gesamt</b>  | <b>649,0</b> | <b>2.361,2</b>      | <b>95,6</b> | <b>89,6</b> | <b>3.195,4</b> |

**Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5**

| Länder         | Staat        | Gebietskörperschaft |             | Sonstige    | Gesamt         |
|----------------|--------------|---------------------|-------------|-------------|----------------|
|                |              | regionale           | örtliche    |             |                |
| Deutschland    | 172,1        | 2.266,1             | 29,5        | 34,0        | <b>2.501,7</b> |
| Italien        | 89,0         | -                   | -           | -           | <b>89,0</b>    |
| Frankreich     | 25,0         | -                   | -           | -           | <b>25,0</b>    |
| Großbritannien | -            | -                   | -           | 7,5         | <b>7,5</b>     |
| Irland         | 25,0         | -                   | -           | -           | <b>25,0</b>    |
| Österreich     | 195,2        | 25,0                | -           | -           | <b>220,2</b>   |
| Spanien        | -            | 148,5               | 35,0        | 4,3         | <b>187,9</b>   |
| Schweiz        | -            | 50,0                | -           | -           | <b>50,0</b>    |
| Ungarn         | 25,0         | -                   | -           | -           | <b>25,0</b>    |
| Japan          | 50,0         | -                   | 20,0        | -           | <b>70,0</b>    |
| Portugal       | 25,0         | 30,0                | -           | -           | <b>55,0</b>    |
| Luxemburg      | -            | -                   | -           | 49,4        | <b>49,4</b>    |
| <b>Gesamt</b>  | <b>606,3</b> | <b>2.519,6</b>      | <b>84,5</b> | <b>95,2</b> | <b>3.305,6</b> |

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