



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	2.392,9	2.043,2	349,7
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.294,4	2.752,8	541,6
davon Derivate	143,6	-	
Risikobarwert *)	3.112,3	2.684,2	428,1

*) 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	2.548,2	2.197,3	350,9
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.302,0	2.902,0	400,0
davon Derivate	144,7	-	
Risikobarwert *)	3.228,5	2.839,1	389,4

*) 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	2.392,9	2.043,2	349,7
Barwert	3.294,4	2.752,8	541,6

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.548,2	2.197,3	350,9
Barwert	3.302,0	2.902,0	400,0

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	54,7	49,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1,9	49,8
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	101,7	213,9
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	146,7	272,9
mehr als 2 bis 3 Jahre	388,7	171,6
mehr als 3 bis 4 Jahre	168,1	138,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	120,7	37,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	611,7	603,0
mehr als 10 Jahre	798,7	506,1
Total	2.392,9	2.043,2

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	173,1	48,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	111,6	77,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	54,5	49,6
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	2,7	50,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	291,8	476,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	283,6	171,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	191,7	156,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	587,2	561,7
mehr als 10 Jahre	852,0	605,8
Total	2.548,2	2.197,3

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. €	54,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	782,7
mehr als 100 Mio. €	1.556,0
Total	2.392,9

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	52,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	676,1
mehr als 100 Mio. €	1.819,9
Total	2.548,2

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	1.886,9	-	98,0	1.417,4	-	314,4	0,8	4,7	28,3	23,3
EU-Institutionen	149,9	-	-	-	-	-	149,9	-	-	-
Frankreich	57,1	-	55,0	-	2,1	-	-	-	-	-
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	2.392,9	-	292,0	1.557,4	22,1	314,4	150,7	4,7	28,3	23,3

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

Länder	Staat Vorjahr	Gebietskörperschaft		Sonstige	Gesamt
		regionale	örtliche		
Deutschland	9,2	1.465,0	32,7	431,5	1.938,4
EU-Institutionen	-	-	-	81,4	81,4
Frankreich	55,0	-	3,00	-	58,0
Italien	39,0	-	-	-	39,0
Japan	-	-	20,0	-	20,0
Österreich	217,4	25,0	-	29,0	271,4
Polen	25,0	-	-	-	25,0
Spanien	-	115,0	-	-	115,0
Total	345,6	1.605,0	55,7	541,9	2.548,2

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	
				-
				-
Total				-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe			2.043,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.392,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR				428,2 Mio. €
GBP				-0,1 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe			2.197,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			78,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.548,2	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			85,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR				389,4 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.