



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	2.350,1	2.009,8	340,3
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.102,5	2.649,5	453,0
davon Derivate	139,1	-	
Risikobarwert *)	2.929,7	2.574,2	355,5

*) 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	2.493,4	2.151,4	342,0
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.248,3	2.830,0	418,3
davon Derivate	135,9	-	
Risikobarwert *)	3.051,3	2.709,5	341,8

*) 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	2.350,1	2.009,8	340,3
Barwert	3.102,5	2.649,5	453,0

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.493,4	2.151,4	342,0
Barwert	3.248,3	2.830,0	418,3

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	55,2	82,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	71,4	125,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	67,2	114,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	253,2	322,5
mehr als 2 bis 3 Jahre	307,1	113,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	114,6	113,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	160,7	37,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	593,7	593,4
mehr als 10 Jahre	727,0	507,7
Total	2.350,1	2.009,8

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	106,6	49,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	59,2	56,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	54,1	82,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	72,4	125,7
mehr als 2 bis 3 Jahre	343,6	426,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	154,5	118,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	176,7	123,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	673,9	609,2
mehr als 10 Jahre	852,4	560,3
Total	2.493,4	2.151,4

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. €	54,1
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	737,1
mehr als 100 Mio. €	1.558,9
Total	2.350,1

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	57,9
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	653,6
mehr als 100 Mio. €	1.781,9
Total	2.493,4

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	1.844,1	-	53,0	1.418,4	-	316,5	0,8	4,6	28,1	22,7
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	2.350,1	-	247,0	1.558,4	22,1	316,5	150,7	4,6	28,1	22,7

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

Länder	Staat Vorjahr	Gebietskörperschaft		Sonstige	Gesamt
		regionale	örtliche		
Deutschland	9,1	1.439,7	32,3	319,1	1.800,2
EU-Institutionen	-	-	-	149,9	149,9
Frankreich	55,0	-	2,90	-	57,9
Italien	39,0	-	-	-	39,0
Japan	-	-	20,0	-	20,0
Österreich	217,4	25,0	-	44,0	286,4
Polen	25,0	-	-	-	25,0
Spanien	-	115,0	-	-	115,0
Total	345,5	1.579,7	55,2	513,0	2.493,4

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			2.009,8	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.350,1	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
EUR			355,5	Mio. €
GBP			-0,1	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe			2.151,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			77,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.493,4	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			85,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
EUR			341,8	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.