

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

§28 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 3

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	2.445,1	2.255,5	189,6
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.367,6	2.879,5	488,1
davon Derivate	106,9	-	
Risikobarwert ⁽²⁾	3.105,7	2.739,5	366,2

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.257,7	1.941,6	316,1
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.912,6	2.460,4	452,2
davon Derivate	119,1	-	
Risikobarwert ⁽²⁾	2.715,5	2.331,7	383,8

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	2.445,1	2.255,5	189,6
Barwert	3.367,6	2.879,5	488,1

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.257,7	1.941,6	316,1
Barwert	2.912,6	2.460,4	452,2

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾
bis zu 6 Monate	206,5	182,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	178,8	314,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	31,3	226,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	53,1	45,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	104,9	121,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	393,8	208,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	131,5	105,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	339,4	750,8
mehr als 10 Jahre	1.005,8	301,2
Total	2.445,1	2.255,5

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	345,7	322,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	100,4	81,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	71,2	59,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	125,7	117,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	118,2	95,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	117,7	111,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	322,8	208,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	336,4	637,1
mehr als 10 Jahre	719,6	308,1
Total	2.257,7	1.941,6

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. €	192,5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	737,7
mehr als 100 Mio. €	1.484,9
Total	2.415,1

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	251,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	849,9
mehr als 100 Mio. €	1.156,1
Total	2.257,7

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	Staat	davon geschuldet von			davon gewährleistet von			
				Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.616,3	-	-	1.133,1	323,1	63,1	0,2	2,0	79,6	0,2
Frankreich	0,6	-	-	-	0,6	-	-	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	348,2	-	208,2	25,0	-	-	100,0	-	-	-
Portugal	35,0	-	35,0	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	375,0	-	260,0	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	2.415,1	-	553,2	1.273,1	343,7	63,1	100,2	2,0	79,6	0,2

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

Länder	Gesamt	In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Staat	davon geschuldet von			davon gewährleistet von			
				Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.743,8	-	2,0	1.109,4	363,5	147,8	0,2	5,6	94,6	20,7
EU-Institutionen	113,9	-	-	-	-	-	113,9	-	-	-
Frankreich	51,0	-	50,0	-	1,0	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	150,0	-	75,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-

Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	2.257,7	-	191,0	1.249,4	384,5	147,8	164,1	5,6	94,6	20,7

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	
Deutschland		15,0		15,0
Österreich		15,0		15,0
Total		30,0		30,0

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	-	5,0	-	5,0
Total	-	5,0	-	5,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe ⁽¹⁾	2.255,5	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	83,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	2.445,1	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	88,5	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung	
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CHF	53,7 Mio. €
EUR	317,9 Mio. €
GBP	0 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe ⁽²⁾	1.941,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	80,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	2.257,7	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	88,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung	
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
CHF	54,7 Mio. €
EUR	334,6 Mio. €
GBP	0 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

⁽¹⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0 Mio. €

⁽²⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0 Mio. €

⁽³⁾ - dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO