

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	1.577,2	1.487,7	89,5
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.178,4	1.912,1	266,3
davon Derivate	69,4	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.018,6	1.815,2	203,4

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.952,1	1.759,1	193,0
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.797,9	2.280,4	517,5
davon Derivate	77,8	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.557,0	2.170,6	386,4

¹⁾ 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 ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	1.577,2	1.487,7	89,5
Barwert	2.178,4	1.912,1	266,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.952,1	1.759,1	193,0
Barwert	2.797,9	2.280,4	517,5

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	128,0	94,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	18,6	27,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	111,4	114,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	157,5	94,4
mehr als 2 bis 3 Jahre	134,1	105,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	29,2	189,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	50,5	168,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	246,1	399,4
mehr als 10 Jahre	701,8	294,7
Total	1.577,2	1.487,7

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	51,4	226,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	53,1	45,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	101,4	94,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	28,6	27,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	318,9	208,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	131,0	105,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	29,3	189,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	310,5	568,5
mehr als 10 Jahre	927,9	294,3
Total	1.952,1	1.759,1

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. €	163,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	467,1
mehr als 100 Mio.€	931,9
Total	1.562,2

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	191,9
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	543,6
mehr als 100 Mio.€	1.186,6
Total	1.922,1

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	1.193,2	-	-	882,7	268,0	17,9	0,1	1,2	23,30	-
EU-Institutionen	49,0	-	-	-	-	-	49,0	-	-	-
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	20,0	-	-	20,0	-	-	-	-	-	-
Total	1.562,2	0,0	205,0	927,7	288,0	17,9	99,1	1,2	23,3	0,0

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	1.406,9	-	-	1.060,4	290,8	27,9	0,1	1,5	26,1	0,1
Frankreich	0,2	-	-	-	0,2	-	-	-	-	-
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	295,0	-	200,0	25,0	-	-	70,0	-	-	-
Slowenien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	170,0	-	-	130,0	15,0	25,0	-	-	-	-
Total	1.922,1	0,0	230,0	1.215,4	326,0	52,9	70,1	1,5	26,1	0,1

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	
Österreich	-	15,0	0,0	15,0
Total	-	15,0	-	15,0

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

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 1	Geldforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 2	Gesamt
Deutschland	-	15,0	15,0
Österreich	-	15,0	15,0
Total	-	30,0	30,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe⁽¹⁾			1.487,7	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			85,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.577,2	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			92,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			203,4	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe⁽²⁾			1.759,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			78,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.952,1	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			386,4	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: 0,0 Mio. €

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

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