



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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	2.433,9	2.080,9	353,0
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.351,3	2.813,0	538,3
davon Derivate	151,4	-	
Risikobarwert *)	3.175,1	2.737,1	438,0

*) 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	2.646,6	2.257,2	389,4
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.354,0	2.932,1	421,9
davon Derivate	127,9	-	
Risikobarwert *)	3.353,9	2.932,1	421,8

*) 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	2.433,9	2.080,9	353,0
Barwert	3.351,3	2.813,0	538,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.646,6	2.257,2	389,4
Barwert	3.354,0	2.932,1	421,9

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	54,2	56,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	54,1	82,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	71,4	125,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	67,2	114,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	453,7	370,8
mehr als 3 bis 4 Jahre	163,1	157,2
mehr als 4 bis 5 Jahre	132,8	55,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	618,6	588,0
mehr als 10 Jahre	818,8	531,2
Total	2.433,9	2.080,9

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	191,6	83,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	86,0	49,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	58,9	56,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	54,1	82,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	171,1	240,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	403,7	359,8
mehr als 4 bis 5 Jahre	226,8	157,2
mehr als 5 bis 10 Jahre	610,7	549,7
mehr als 10 Jahre	843,7	678,8
Total	2.646,6	2.257,2

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. €	61,1
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	782,7
mehr als 100 Mio. €	1.590,1
Total	2.433,9

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	58,5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	702,9
mehr als 100 Mio. €	1.885,2
Total	2.646,6

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	1.927,5	-	98,0	1.406,5	-	359,2	6,9	4,8	28,8	23,3
EU-Institutionen	149,9	-	-	-	-	-	149,9	-	-	-
Frankreich	57,5	-	55,0	-	2,5	-	-	-	-	-
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	2.433,9	-	292,0	1.546,5	22,5	359,2	156,8	4,8	28,8	23,3

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

Länder	Staat Vorjahr	Gebietskörperschaft		Sonstige	Gesamt
		regionale	örtliche		
Deutschland	12,1	1.502,5	33,2	434,7	1.982,5
EU-Institutionen	-	-	-	106,4	106,4
Frankreich	55,0	-	3,30	-	58,3
Italien	39,0	-	-	-	39,0
Japan	-	-	20,0	-	20,0
Österreich	234,4	25,0	-	41,0	300,4
Polen	25,0	-	-	-	25,0
Spanien	-	115,0	-	-	115,0
Total	365,5	1.642,5	56,5	582,1	2.646,6

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			2.080,9	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			77,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.433,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR				438 Mio. €
GBP				-0,1 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe			2.257,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			78,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.646,6	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			80,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR				421,9 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.