



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

| | Deckungsmasse | Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾ | Überdeckung |
|-------------------------------------|---------------|--------------------------------------|-------------|
| Nennwert | 2.374,3 | 2.197,0 | 177,3 |
| davon Derivate | - | - | |
| Barwert | 3.333,7 | 2.812,4 | 521,3 |
| davon Derivate | 86,4 | - | |
| Risikobarwert ⁽³⁾ | 3.050,9 | 2.708,7 | 342,2 |

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

| | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾ | Überdeckung Vorjahr |
|-------------------------------------|-----------------------|--|---------------------|
| Nennwert | 1.964,1 | 1.685,4 | 278,7 |
| davon Derivate | - | - | |
| Barwert | 2.565,3 | 2.154,3 | 411,0 |
| davon Derivate | 100,5 | - | |
| Risikobarwert ⁽³⁾ | 2.378,5 | 2.032,3 | 346,2 |

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 | 2.374,3 | 2.197,0 | 177,3 |
| Barwert | 3.333,7 | 2.812,4 | 521,3 |

Werte des Vorjahres (Mio. €)

| | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾ | Überdeckung Vorjahr |
|-----------------|-----------------------|--|---------------------|
| Nennwert | 1.964,1 | 1.685,4 | 278,7 |
| Barwert | 2.565,3 | 2.154,3 | 411,0 |

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

| Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur | Deckungsmasse | Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾ |
|--|----------------|--------------------------------------|
| bis zu 6 Monate | 150,8 | 310,7 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 167,5 | 190,3 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 41,5 | 188,1 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 43,0 | 111,2 |
| mehr als 2 bis 3 Jahre | 157,4 | 50,1 |
| mehr als 3 bis 4 Jahre | 385,9 | 213,7 |
| mehr als 4 bis 5 Jahre | 131,5 | 100,7 |
| mehr als 5 bis 10 Jahre | 338,9 | 731,0 |
| mehr als 10 Jahre | 957,8 | 301,2 |
| Total | 2.374,3 | 2.197,0 |

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

| Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾ |
|--|-----------------------|--|
| bis zu 6 Monate | 170,8 | 80,3 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 48,5 | 114,0 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 71,9 | 20,4 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 98,3 | 128,3 |
| mehr als 2 bis 3 Jahre | 124,4 | 168,4 |
| mehr als 3 bis 4 Jahre | 114,0 | 40,1 |
| mehr als 4 bis 5 Jahre | 289,7 | 213,7 |
| mehr als 5 bis 10 Jahre | 349,9 | 612,1 |
| mehr als 10 Jahre | 696,6 | 308,1 |
| Total | 1.964,1 | 1.685,4 |

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio. €)

| Stufen | Deckungsmasse |
|-----------------------------------|----------------|
| bis 10 Mio. € | 198,5 |
| mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. € | 730,9 |
| mehr als 100 Mio. € | 1.414,9 |
| Total | 2.344,3 |

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

| Stufen | Deckungsmasse |
|-----------------------------------|----------------|
| bis 10 Mio. € | 229,6 |
| mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. € | 850,8 |
| mehr als 100 Mio. € | 883,7 |
| Total | 1.964,1 |

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 | | | davon geschuldet von | | | | davon gewährleistet von | | | |
|------------------|----------------|--|----------------------|---------------------|--------------|-------------|-------------------------|---------------------|-------------|------------|
| | Gesamt | in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | Staat | Gebietskörperschaft | | Sonstige | Staat | Gebietskörperschaft | | Sonstige |
| | | | | regionale | örtliche | | | regionale | örtliche | |
| Deutschland | 1.575,7 | - | - | 1.133,3 | 315,5 | 43,0 | 0,1 | 1,8 | 81,9 | 0,1 |
| EU-Institutionen | 5,0 | - | - | - | - | - | 5,0 | - | - | - |
| Frankreich | 0,4 | - | - | - | 0,4 | - | - | - | - | - |
| Italien | 25,0 | - | 25,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Japan | 20,0 | - | - | - | 20,0 | - | - | - | - | - |
| Österreich | 333,2 | - | 208,2 | 25,0 | - | - | 100,0 | - | - | - |
| Portugal | 35,0 | - | 35,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Slowenien | 25,0 | - | 25,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Spanien | 325,0 | - | 165,0 | 130,0 | 5,0 | 25,0 | - | - | - | - |
| Total | 2.344,3 | - | 458,2 | 1.288,3 | 340,9 | 68,0 | 105,1 | 1,8 | 81,9 | 0,1 |

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

| Länder | | | davon geschuldet von | | | | davon gewährleistet von | | | |
|------------------|----------------|--|----------------------|---------------------|--------------|-------------|-------------------------|---------------------|-------------|-------------|
| | Gesamt | in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | Staat | Gebietskörperschaft | | Sonstige | Staat | Gebietskörperschaft | | Sonstige |
| | | | | regionale | örtliche | | | regionale | örtliche | |
| Deutschland | 1.422,4 | - | 2,0 | 932,0 | 348,5 | 20,7 | 0,2 | 4,0 | 94,3 | 20,7 |
| EU-Institutionen | 91,9 | - | - | - | - | - | 91,9 | - | - | - |
| Frankreich | 75,8 | - | 75,0 | - | 0,8 | - | - | - | - | - |
| Italien | 39,0 | - | 39,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Japan | 20,0 | - | - | - | 20,0 | - | - | - | - | - |
| Österreich | 175,0 | - | 100,0 | 25,0 | - | - | 50,0 | - | - | - |
| Polen | 25,0 | - | 25,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Spanien | 115,0 | - | - | 115,0 | - | - | - | - | - | - |
| Total | 1.964,1 | - | 241,0 | 1.072,0 | 369,3 | 20,7 | 142,1 | 4,0 | 94,3 | 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 | |
| | | | | |
| Total | | | | |

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

| | | | | |
|---|--|--|---------|--------|
| Umlaufende Pfandbriefe⁽¹⁾ | | | 2.197,0 | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | | | 82,9 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 9

| | | | | |
|--|--|--|---------|--------|
| Deckungsmasse | | | 2.374,3 | Mio. € |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt | | | - | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | | | 90,5 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

| Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung | | | | |
|---|--|--|-------|-------------------------------|
| Währung | | | | Saldo aus Aktiv-/ Passivseite |
| CHF | | | 54 | Mio. € |
| EUR | | | 293,6 | Mio. € |
| GBP | | | 0 | Mio. € |

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

| | | | | |
|---|--|--|---------|--------|
| Umlaufende Pfandbriefe⁽²⁾ | | | 1.685,4 | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | | | 77,8 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 9

| | | | | |
|--|--|--|---------|--------|
| Deckungsmasse | | | 1.964,1 | Mio. € |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt | | | - | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | | | 87,9 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

| Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung | | | | |
|---|--|--|-------|-------------------------------|
| Währung | | | | Saldo aus Aktiv-/ Passivseite |
| CHF | | | 55,2 | Mio. € |
| EUR | | | 296,7 | 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