

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	1.627,8	1.507,9	119,9
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.267,8	1.962,6	305,2
davon Derivate	73,3	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.092,1	1.875,9	216,2

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.048,9	1.886,4	162,5
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.896,7	2.427,7	469,0
davon Derivate	82,4	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.649,4	2.312,8	336,6

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	1.627,8	1.507,9	119,9
Barwert	2.267,8	1.962,6	305,2

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.048,9	1.886,4	162,5
Barwert	2.896,7	2.427,7	469,0

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	118,1	111,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	43,0	4,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	49,5	45,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	179,2	101,2
mehr als 2 bis 3 Jahre	151,5	183,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	57,9	130,0
mehr als 4 bis 5 Jahre	34,8	230,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	264,4	408,7
mehr als 10 Jahre	729,4	292,6
Total	1.627,8	1.507,9

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	102,9	190,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	61,5	188,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	18,0	111,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	103,0	4,9
mehr als 2 bis 3 Jahre	278,7	146,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	148,4	183,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	58,0	130,0
mehr als 5 bis 10 Jahre	327,9	639,8
mehr als 10 Jahre	950,5	292,3
Total	2.048,9	1.886,4

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. €	168,4
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	464,9
mehr als 100 Mio.€	979,5
Total	1.612,8

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	176,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	655,5
mehr als 100 Mio.€	1.186,7
Total	2.018,9

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	1.247,8	-	-	930,1	274,3	18,0	0,1	1,3	23,90	0,1
EU-Institutionen	45,0	-	-	-	-	-	45,0	-	-	-
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	1.612,8	0,0	205,0	975,1	294,3	18,0	95,1	1,3	23,9	0,1

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	1.423,7	-	-	1.080,3	296,8	18,0	0,1	1,6	26,8	0,1
Frankreich	0,2	-	-	-	0,2	-	-	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	295,0	-	200,0	25,0	-	-	70,0	-	-	-
Portugal	35,0	-	35,0	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	195,0	-	35,0	130,0	5,0	25,0	-	-	-	-
Total	2.018,9	0,0	320,0	1.235,3	322,0	43,0	70,1	1,6	26,8	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⁾			1.507,9	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			84,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.627,8	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			216,2	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe⁽²⁾			1.886,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			80,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.048,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			89,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			336,7	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