

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	1.480,7	1.396,7	84,0
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.054,0	1.798,4	255,6
davon Derivate	64,2	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	1.901,4	1.706,4	195,0

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.886,0	1.696,1	189,9
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.707,8	2.191,7	516,1
davon Derivate	63,7	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2.486,4	2.078,7	407,7

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	1.480,7	1.396,7	84,0
Barwert	2.054,0	1.798,4	255,6

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.886,0	1.696,1	189,9
Barwert	2.707,8	2.191,7	516,1

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	43,1	5,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	49,5	45,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	179,1	101,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	75,7	112,5
mehr als 2 bis 3 Jahre	131,5	100,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	28,5	242,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	54,6	140,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	224,9	364,5
mehr als 10 Jahre	693,8	284,7
Total	1.480,7	1.396,7

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	31,5	188,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	48,0	111,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	103,0	4,9
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	49,5	45,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	285,8	213,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	131,6	100,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	28,4	242,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	283,3	495,5
mehr als 10 Jahre	924,9	294,4
Total	1.886,0	1.696,1

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. €	154,3
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	435,0
mehr als 100 Mio.€	891,4
Total	1.480,7

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	187,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	511,6
mehr als 100 Mio.€	1.171,7
Total	1.871,0

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	1.165,7	-	-	861,1	262,6	18,0	0,1	1,1	22,80	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	20,0	-	-	20,0	-	-	-	-	-	-
Total	1.480,7	0,0	200,0	906,1	282,6	18,0	50,1	1,1	22,8	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	1.391,0	-	-	1.060,4	285,6	18,0	0,1	1,4	25,4	0,1
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	280,0	-	200,0	25,0	-	-	55,0	-	-	-
Spanien	175,0	-	-	130,0	35,0	10,0	-	-	-	-
Total	1.871,0	0,0	205,0	1.215,4	340,6	28,0	55,1	1,4	25,4	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	
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
Österreich	-	15,0	0,0	15,0
Total	-	15,0	-	15,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe⁽¹⁾			1.396,7	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			84,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.480,7	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			195,0	Mio. €
GBP			0,0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe⁽²⁾			1.696,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			86,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1.886,0	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
EUR			407,7	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