

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 <sup>(1)</sup>	Überdeckung
<b>Nennwert</b>	1.478,4	1.393,7	<b>84,7</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.017,7	1.761,5	<b>256,2</b>
davon Derivate	58,7	-	
<b>Risikobarwert <sup>(2)</sup></b>	1.871,6	1.675,4	<b>196,2</b>

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.788,9	1.533,0	<b>255,9</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.564,8	2.003,5	<b>561,3</b>
davon Derivate	58,6	-	
<b>Risikobarwert <sup>(2)</sup></b>	2.360,0	1.894,9	<b>465,1</b>

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>	Überdeckung
<b>Nennwert</b>	1.478,4	1.393,7	<b>84,7</b>
<b>Barwert</b>	2.017,7	1.761,5	<b>256,2</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.788,9	1.533,0	<b>255,9</b>
<b>Barwert</b>	2.564,8	2.003,5	<b>561,3</b>

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>
bis zu 6 Monate	34,7	27,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	122,4	114,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	157,5	94,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	15,2	89,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	154,9	95,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	25,5	253,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	79,7	114,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	197,3	318,8
mehr als 10 Jahre	691,2	286,8
<b>Total</b>	<b>1.478,4</b>	<b>1.393,7</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	51,0	45,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	96,4	94,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	28,6	27,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	116,5	114,4
mehr als 2 bis 3 Jahre	187,7	183,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	129,9	95,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	40,5	253,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	265,9	423,9
mehr als 10 Jahre	872,4	296,3
<b>Total</b>	<b>1.788,9</b>	<b>1.533,0</b>

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. €	156,3
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	414,7
mehr als 100 Mio. €	907,4
<b>Total</b>	<b>1.478,4</b>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	187,5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	459,7
mehr als 100 Mio. €	1.126,7
<b>Total</b>	<b>1.773,9</b>

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	Staat	davon geschuldet von			davon gewährleistet von			
				Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.152,4	-	-	854,9	256,3	17,9	0,1	1,0	22,2	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	31,0	-	-	31,0	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.478,4</b>	<b>-</b>	<b>200,0</b>	<b>910,9</b>	<b>276,3</b>	<b>17,9</b>	<b>50,1</b>	<b>1,0</b>	<b>22,2</b>	<b>0,0</b>

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

Länder	Gesamt	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Staat	davon geschuldet von			davon gewährleistet von			
				Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.400,9	-	-	1.067,1	279,7	27,9	0,1	1,4	24,6	0,1
EU-Institutionen	40,0	-	-	-	-	-	40,0	-	-	-
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	225,0	-	200,0	25,0	-	-	-	-	-	-
Spanien	83,0	-	15,0	50,0	-	18,0	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.773,9</b>	<b>-</b>	<b>220,0</b>	<b>1.142,1</b>	<b>299,7</b>	<b>45,9</b>	<b>40,1</b>	<b>1,4</b>	<b>24,6</b>	<b>0,1</b>

**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	
	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-	-

**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	
Österreich	-	15,0	-	15,0
<b>Total</b>	-	15,0	-	15,0

**Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte**

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(1)</sup>	1.393,7	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	84,0	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	1.478,4	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	91,6	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung</b>			§28 Abs. 1 Nr. 10
<b>Währung</b>	<b>Saldo aus Aktiv-/ Passivseite</b>		
EUR	196,2	Mio. €	

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(2)</sup>	1.533,0	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	84,9	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	1.788,9	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	90,0	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung</b>			§28 Abs. 1 Nr. 10
<b>Währung</b>	<b>Saldo aus Aktiv-/ Passivseite</b>		
EUR	465,1	Mio. €	
GBP	0	Mio. €	

**Anmerkung:** Weder für den Berichtszeitraum noch den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.

<sup>(1)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: - Mio. €

<sup>(2)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: - Mio. €

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