



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	1,952.1	1,759.1	193.0
davon Derivate	-	-	
Barwert	2,797.9	2,280.4	517.5
davon Derivate	77.8	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	2,557.0	2,170.6	386.4

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2,445.1	2,255.5	189.6
davon Derivate	-	-	
Barwert	3,367.6	2,879.5	488.1
davon Derivate	106.9	-	
Risikobarwert ⁽³⁾	3,105.7	2,739.5	366.2

⁽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	1,952.1	1,759.1	193.0
Barwert	2,797.9	2,280.4	517.5

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2,445.1	2,255.5	189.6
Barwert	3,367.6	2,879.5	488.1

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	51.4	226.2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	53.1	45.3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	101.4	94.0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	28.6	27.1
mehr als 2 bis 3 Jahre	318.9	208.7
mehr als 3 bis 4 Jahre	131.0	105.7
mehr als 4 bis 5 Jahre	29.3	189.3
mehr als 5 bis 10 Jahre	310.5	568.5
mehr als 10 Jahre	927.9	294.3
Total	1,952.1	1,759.1

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	206.5	182.1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	178.8	314.5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	31.3	226.1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	53.1	45.3
mehr als 2 bis 3 Jahre	104.9	121.1
mehr als 3 bis 4 Jahre	393.8	208.7
mehr als 4 bis 5 Jahre	131.5	105.7
mehr als 5 bis 10 Jahre	339.4	750.8
mehr als 10 Jahre	1,005.8	301.2
Total	2,445.1	2,255.5

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. €	191.9
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	543.6
mehr als 100 Mio. €	1,186.6
Total	1,922.1

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	192.5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	737.7
mehr als 100 Mio. €	1,484.9
Total	2,415.1

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	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	1,406.9	-	-	1,060.4	290.8	27.9	0.1	1.5	26.10	0.1
Frankreich	0.2	-	-	-	0.2	-	-	-	-	-
Italien	5.0	-	5.0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20.0	-	-	-	20.0	-	-	-	-	-
Österreich	295.0	-	200.0	25.0	-	-	70.0	-	-	-
Slowenien	25.0	-	25.0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	170.0	-	-	130.0	15.0	25.0	-	-	-	-
Total	1,922.1	-	230.0	1,215.4	326.0	52.9	70.1	1.5	26.1	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	1,601.3	-	-	1,133.1	323.1	63.1	0.2	2.0	79.6	0.2
Frankreich	0.6	-	-	-	0.6	-	-	-	-	-
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	375.0	-	260.0	115.0	-	-	-	-	-	-
Total	2,415.1	-	553.2	1,273.1	343.7	63.1	100.2	2.0	79.6	0.2

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	0,0	15,0
Österreich	-	15,0	0,0	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	
Deutschland	-	15,0	0,0	15,0
Österreich	-	15,0	0,0	15,0
Total	-	30,0	-	30,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe⁽¹⁾			1,759,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			78,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			1,952,1	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			386,4	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

Umlaufende Pfandbriefe⁽²⁾			2,255,5	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			83,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2,445,1	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
CHF			53,7	Mio. €
EUR			317,9	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