

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>	1.505,6	1.318,8	<b>186,8</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	1.738,0	1.505,0	<b>233,0</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Risikobarwert <sup>(2)</sup></b>	1.333,7	1.248,7	<b>85,0</b>

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.577,2	1.487,7	<b>89,5</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.178,4	1.912,1	<b>266,3</b>
davon Derivate	69,4	-	
<b>Risikobarwert <sup>(2)</sup></b>	2.018,6	1.815,2	<b>203,4</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>	1.505,6	1.318,8	<b>186,8</b>
<b>Barwert</b>	1.738,0	1.505,0	<b>233,0</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.577,2	1.487,7	<b>89,5</b>
<b>Barwert</b>	2.178,4	1.912,1	<b>266,3</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	136,4	114,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	123,5	96,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	15,2	89,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	132,9	19,0
mehr als 2 bis 3 Jahre	29,2	191,8
mehr als 3 bis 4 Jahre	35,5	168,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	64,9	136,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	192,4	267,4
mehr als 10 Jahre	775,6	235,4
<b>Total</b>	<b>1.505,6</b>	<b>1.318,8</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	128,0	94,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	18,6	27,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	111,4	114,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	157,5	94,4
mehr als 2 bis 3 Jahre	134,1	105,7
mehr als 3 bis 4 Jahre	29,2	189,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	50,5	168,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	246,1	399,4
mehr als 10 Jahre	701,8	294,7
<b>Total</b>	<b>1.577,2</b>	<b>1.487,7</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. €	151,3
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	522,8
mehr als 100 Mio. €	831,5
<b>Total</b>	<b>1.505,6</b>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	163,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	467,1
mehr als 100 Mio. €	931,9
<b>Total</b>	<b>1.562,2</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	1.140,6	-	-	861,8	239,0	18,0	0,1	0,8	20,9	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	70,0	-	-	70,0	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.505,6</b>	<b>-</b>	<b>200,0</b>	<b>956,8</b>	<b>259,0</b>	<b>18,0</b>	<b>50,1</b>	<b>0,8</b>	<b>20,9</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	1.193,2	-	-	882,7	268,0	17,9	0,1	1,2	23,3	-
EU-Institutionen	49,0	-	-	-	-	-	49,0	-	-	-
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	20,0	-	-	20,0	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.562,2</b>	<b>-</b>	<b>205,0</b>	<b>927,7</b>	<b>288,0</b>	<b>17,9</b>	<b>99,1</b>	<b>1,2</b>	<b>23,3</b>	<b>0,0</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	
	-	-	-	-
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
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.D. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Österreich	-	15,0	-	15,0
Total	-	15,0	-	15,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(1)</sup>	1.318,8	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	96,6	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	1.505,6	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	92,6	%	§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	85,0	Mio. €	

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(2)</sup>	1.487,7	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	85	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
<b>Deckungsmasse</b>	1.577,2	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	92,0	%	§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	203,4	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