



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

| | Deckungsmasse | Pfandbriefe im Umlauf | Überdeckung |
|-------------------------|---------------|-----------------------|--------------|
| Nennwert | 2.257,7 | 1.941,6 | 316,1 |
| davon Derivate | - | - | |
| Barwert | 2.912,6 | 2.460,4 | 452,2 |
| davon Derivate | 119,1 | - | |
| Risikobarwert *) | 2.715,5 | 2.331,7 | 383,8 |

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

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

| | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr | Überdeckung Vorjahr |
|-------------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------|
| Nennwert | 2.841,7 | 2.231,1 | 610,6 |
| davon Derivate | - | - | |
| Barwert | 3.583,0 | 2.826,7 | 756,3 |
| davon Derivate | 133,9 | - | |
| Risikobarwert *) | 3.354,5 | 2.676,2 | 678,3 |

*) 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 | Überdeckung |
|-----------------|---------------|-----------------------|--------------|
| Nennwert | 2.257,7 | 1.941,6 | 316,1 |
| Barwert | 2.912,6 | 2.460,4 | 452,2 |

Werte des Vorjahres (Mio. €)

| | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr | Überdeckung Vorjahr |
|-----------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------|
| Nennwert | 2.841,7 | 2.231,1 | 610,6 |
| Barwert | 3.583,0 | 2.826,7 | 756,3 |

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

| Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur | Deckungsmasse | Pfandbriefe im Umlauf |
|--|----------------|-----------------------|
| bis zu 6 Monate | 345,7 | 322,6 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 100,4 | 81,3 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 71,2 | 59,7 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 125,7 | 117,6 |
| mehr als 2 bis 3 Jahre | 118,2 | 95,4 |
| mehr als 3 bis 4 Jahre | 117,7 | 111,1 |
| mehr als 4 bis 5 Jahre | 322,8 | 208,7 |
| mehr als 5 bis 10 Jahre | 336,4 | 637,1 |
| mehr als 10 Jahre | 719,6 | 308,1 |
| Total | 2.257,7 | 1.941,6 |

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

| Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur | Deckungsmasse Vorjahr | Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr |
|--|-----------------------|-------------------------------|
| bis zu 6 Monate | 132,1 | 161,2 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 133,5 | 123,5 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 287,4 | 322,5 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 131,0 | 86,3 |
| mehr als 2 bis 3 Jahre | 364,9 | 177,2 |
| mehr als 3 bis 4 Jahre | 123,2 | 95,4 |
| mehr als 4 bis 5 Jahre | 155,3 | 111,1 |
| mehr als 5 bis 10 Jahre | 721,6 | 634,7 |
| mehr als 10 Jahre | 792,7 | 519,2 |
| Total | 2.841,7 | 2.231,1 |

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. € | 251,7 |
| mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. € | 849,9 |
| mehr als 100 Mio. € | 1.156,1 |
| Total | 2.257,7 |

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

| Stufen | Deckungsmasse |
|-----------------------------------|----------------|
| bis 10 Mio. € | 261,0 |
| mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. € | 1.050,2 |
| mehr als 100 Mio. € | 1.530,5 |
| Total | 2.841,7 |

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 | 1.743,8 | - | 2,0 | 1.109,4 | 363,5 | 147,8 | 0,2 | 5,6 | 94,6 | 20,7 |
| EU-Institutionen | 113,9 | - | - | - | - | - | 113,9 | - | - | - |
| Frankreich | 51,0 | - | 50,0 | - | 1,0 | - | - | - | - | - |
| Italien | 39,0 | - | 39,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Japan | 20,0 | - | - | - | 20,0 | - | - | - | - | - |
| Österreich | 150,0 | - | 75,0 | 25,0 | - | - | 50,0 | - | - | - |
| Polen | 25,0 | - | 25,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Spanien | 115,0 | - | - | 115,0 | - | - | - | - | - | - |
| Total | 2.257,7 | - | 191,0 | 1.249,4 | 384,5 | 147,8 | 164,1 | 5,6 | 94,6 | 20,7 |

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 | 2.336,1 | - | 2,0 | 1.451,3 | 415,9 | 332,6 | 0,2 | 6,1 | 106,0 | 22,0 |
| EU-Institutionen | 149,9 | - | - | - | - | - | 149,9 | - | - | - |
| Frankreich | 56,7 | - | 55,0 | - | 1,7 | - | - | - | - | - |
| Italien | 39,0 | - | 39,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Japan | 20,0 | - | - | - | 20,0 | - | - | - | - | - |
| Österreich | 100,0 | - | 75,0 | 25,0 | - | - | - | - | - | - |
| Polen | 25,0 | - | 25,0 | - | - | - | - | - | - | - |
| Spanien | 115,0 | - | - | 115,0 | - | - | - | - | - | - |
| Total | 2.841,7 | - | 196,0 | 1.591,3 | 437,6 | 332,6 | 150,1 | 6,1 | 106,0 | 22,0 |

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 | - | 5,0 | - | 5,0 |
| Total | - | 5,0 | - | 5,0 |

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 | |
| | | | | |
| Total | | | | |

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

| | | | | |
|--|--|--|---------|--------|
| Umlaufende Pfandbriefe | | | 1.941,6 | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | | | 80,8 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 9

| | | | | |
|--|--|--|---------|--------|
| Deckungsmasse | | | 2.257,7 | Mio. € |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt | | | - | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | | | 88,9 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

| Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung | | | | |
|---|--|--|-------------------------------|--------|
| Währung | | | Saldo aus Aktiv-/ Passivseite | |
| CHF | | | 54,7 | Mio. € |
| EUR | | | 334,6 | Mio. € |
| GBP | | | 0 | Mio. € |

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

| | | | | |
|--|--|--|---------|--------|
| Umlaufende Pfandbriefe | | | 2.231,1 | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe | | | 79,0 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 9

| | | | | |
|--|--|--|---------|--------|
| Deckungsmasse | | | 2.841,7 | Mio. € |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt | | | - | Mio. € |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | | | 88,9 | % |

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

| Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung | | | | |
|---|--|--|-------------------------------|--------|
| Währung | | | Saldo aus Aktiv-/ Passivseite | |
| CHF | | | 61 | Mio. € |
| EUR | | | 623,6 | |
| GBP | | | -0,1 | Mio. € |

§28 Abs. 1 Nr. 10

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