



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

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

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	2.374,3	2.197,0	<b>177,3</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	3.333,7	2.812,4	<b>521,3</b>
davon Derivate	86,4	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	3.050,9	2.708,7	<b>342,2</b>

<sup>(1)</sup> 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 <sup>(1)</sup>	Überdeckung
<b>Nennwert</b>	1.886,0	1.696,1	<b>189,9</b>
<b>Barwert</b>	2.707,8	2.191,7	<b>516,1</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	2.374,3	2.197,0	<b>177,3</b>
<b>Barwert</b>	3.333,7	2.812,4	<b>521,3</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	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
<b>Total</b>	<b>1.886,0</b>	<b>1.696,1</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	150,8	310,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	167,5	190,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	41,5	188,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	43,0	111,2
mehr als 2 bis 3 Jahre	157,4	50,1
mehr als 3 bis 4 Jahre	385,9	213,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	131,5	100,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	338,9	731,0
mehr als 10 Jahre	957,8	301,2
<b>Total</b>	<b>2.374,3</b>	<b>2.197,0</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. €	187,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	511,6
mehr als 100 Mio. €	1.171,7
<b>Total</b>	<b>1.871,0</b>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	198,5
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	730,9
mehr als 100 Mio. €	1.414,9
<b>Total</b>	<b>2.344,3</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	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	25,40	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	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.871,0</b>	<b>0,0</b>	<b>205,0</b>	<b>1.215,4</b>	<b>340,6</b>	<b>28,0</b>	<b>55,1</b>	<b>1,4</b>	<b>25,4</b>	<b>0,1</b>

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	1.575,7	-	-	1.133,3	315,5	43,0	0,1	1,8	81,9	0,1
EU-Institutionen	5,0	-	-	-	-	-	5,0	-	-	-
Frankreich	0,4	-	-	-	0,4	-	-	-	-	-
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	325,0	-	165,0	130,0	5,0	25,0	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2.344,3</b>	<b>0,0</b>	<b>458,2</b>	<b>1.288,3</b>	<b>340,9</b>	<b>68,0</b>	<b>105,1</b>	<b>1,8</b>	<b>81,9</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	
Österreich	-	15,0	0,0	15,0
<b>Total</b>	-	<b>15,0</b>	-	<b>15,0</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	
Deutschland	-	15,0	0,0	15,0
Österreich	-	15,0	0,0	15,0
<b>Total</b>	-	<b>30,0</b>	-	<b>30,0</b>

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe<sup>(1)</sup></b>			1.696,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			86,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			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	
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe<sup>(2)</sup></b>			2.197,0	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			82,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			2.374,3	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,5	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
			CHF	
EUR			293,6	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.

<sup>(1)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0,0 Mio. €

<sup>(2)</sup> - Davon in den Eigenbestand übernommen: 0,0 Mio. €

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