

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

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.964,1	1.685,4	278,7
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.565,3	2.154,3	411,0
davon Derivate	100,5	-	
<b>Risikobarwert <sup>(2)</sup></b>	2.378,5	2.032,3	346,2

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>	2.374,3	2.197,0	177,3
<b>Barwert</b>	3.333,7	2.812,4	521,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.964,1	1.685,4	278,7
<b>Barwert</b>	2.565,3	2.154,3	411,0

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	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>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	170,8	80,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	48,5	114,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	71,9	20,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	98,3	128,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	124,4	168,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	114,0	40,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	289,7	213,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	349,9	612,1
mehr als 10 Jahre	696,6	308,1
<b>Total</b>	<b>1.964,1</b>	<b>1.685,4</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. €	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>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	229,6
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	850,8
mehr als 100 Mio. €	883,7
<b>Total</b>	<b>1.964,1</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	1.575,7	-	-	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>-</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>

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	1.422,4	-	2,0	932,0	348,5	20,7	0,2	4,0	94,3	20,7
EU-Institutionen	91,9	-	-	-	-	-	91,9	-	-	-
Frankreich	75,8	-	75,0	-	0,8	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-

Osterreich	175,0	-	100,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	1.964,1	-	241,0	1.072,0	369,3	20,7	142,1	4,0	94,3	20,7

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	-	15,0
Osterreich	-	15,0	-	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	
				-
Total	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(1)</sup>	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		Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
Währung		
CHF		54 Mio. €
EUR		293,6 Mio. €
GBP		0 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe</b> <sup>(2)</sup>	1.685,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	77,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>	1.964,1	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	87,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung		Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
Währung		
CHF		55,2 Mio. €
EUR		296,7 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