

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>	1.577,2	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>(3)</sup></b>	2.018,6	1.815,2	<b>203,4</b>

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.952,1	1.759,1	<b>193,0</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.797,9	2.280,4	<b>517,5</b>
davon Derivate	77,8	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	2.557,0	2.170,6	<b>386,4</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>	1.577,2	1.487,7	<b>89,5</b>
<b>Barwert</b>	2.178,4	1.912,1	<b>266,3</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.952,1	1.759,1	<b>193,0</b>
<b>Barwert</b>	2.797,9	2.280,4	<b>517,5</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	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>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
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
<b>Total</b>	<b>1.952,1</b>	<b>1.759,1</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. €	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>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	191,9
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	543,6
mehr als 100 Mio.€	1.186,6
<b>Total</b>	<b>1.922,1</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	davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.193,2	-	-	882,7	268,0	17,9	0,1	1,2	23,30	-
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>0,0</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>

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	1.406,9	-	-	1.060,4	290,8	27,9	0,1	1,5	26,1	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	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.922,1</b>	<b>0,0</b>	<b>230,0</b>	<b>1.215,4</b>	<b>326,0</b>	<b>52,9</b>	<b>70,1</b>	<b>1,5</b>	<b>26,1</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
Deutschland	-	15,0	15,0
Österreich	-	15,0	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>			1.487,7	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			85,0	%

§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. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			92,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR			203,4	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe<sup>(2)</sup></b>			1.759,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			78,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			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

**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