



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>	2.048,9	1.886,4	162,5
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.896,7	2.427,7	469,0
davon Derivate	82,4	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	2.649,4	2.312,8	336,6

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.878,9	1.605,3	273,6
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.541,8	2.114,5	427,3
davon Derivate	109,8	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	2.352,6	1.995,7	356,9

<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>	2.048,9	1.886,4	162,5
<b>Barwert</b>	2.896,7	2.427,7	469,0

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.878,9	1.605,3	273,6
<b>Barwert</b>	2.541,8	2.114,5	427,3

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf <sup>(1)</sup>
bis zu 6 Monate	102,9	190,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	61,5	188,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	18,0	111,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	103,0	4,9
mehr als 2 bis 3 Jahre	278,7	146,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	148,4	183,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	58,0	130,0
mehr als 5 bis 10 Jahre	327,9	639,8
mehr als 10 Jahre	950,5	292,3
<b>Total</b>	<b>2.048,9</b>	<b>1.886,4</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	116,8	114,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	73,7	20,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	82,5	128,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	101,5	57,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	120,8	111,2
mehr als 3 bis 4 Jahre	278,6	141,3
mehr als 4 bis 5 Jahre	98,5	183,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	317,0	538,4
mehr als 10 Jahre	689,5	311,1
<b>Total</b>	<b>1.878,9</b>	<b>1.605,3</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. €	176,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	655,5
mehr als 100 Mio. €	1.186,7
<b>Total</b>	<b>2.018,9</b>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	200,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	798,9
mehr als 100 Mio. €	879,8
<b>Total</b>	<b>1.878,9</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	1.423,7	-	-	1.080,3	296,8	18,0	0,1	1,6	26,80	0,1
Frankreich	0,2	-	-	-	0,2	-	-	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	295,0	-	200,0	25,0	-	-	70,0	-	-	-
Portugal	35,0	-	35,0	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	195,0	-	35,0	130,0	5,0	25,0	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2.018,9</b>	<b>-</b>	<b>320,0</b>	<b>1.235,3</b>	<b>322,0</b>	<b>43,0</b>	<b>70,1</b>	<b>1,6</b>	<b>26,8</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	1.445,1	-	-	942,2	329,6	88,1	0,2	2,1	82,9	-
EU-Institutionen	65,0	-	-	-	-	-	65,0	-	-	-
Frankreich	25,6	-	25,0	-	0,6	-	-	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	158,2	-	83,2	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.878,9</b>	<b>-</b>	<b>158,2</b>	<b>1.082,2</b>	<b>350,2</b>	<b>88,1</b>	<b>115,2</b>	<b>2,1</b>	<b>82,9</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	
Deutschland	-	15,0	-	15,0
Österreich	-	15,0	-	15,0
<b>Total</b>	-	<b>30,0</b>	-	<b>30,0</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	
<b>Total</b>				

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

<b>Umlaufende Pfandbriefe<sup>(1)</sup></b>			1.886,4	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			80,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			2.048,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			89,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung				Saldo aus Aktiv-/ Passivseite
EUR				336,7 Mio. €
GBP				0 Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe<sup>(2)</sup></b>			1.605,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			1.878,9	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
CHF				54,2 Mio. €
EUR				308,3 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