

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	Überdeckung
Nennwert	1.878,9	1.605,3	273,6
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.541,8	2.114,5	427,3
davon Derivate	109,8	-	
Risikobarwert *)	2.352,6	1.995,7	356,9

*) 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	2.284,0	1.958,3	325,7
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.918,8	2.481,9	436,9
davon Derivate	113,2	-	
Risikobarwert *)	2.727,2	2.349,1	378,1

*) 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	1.878,9	1.605,3	273,6
Barwert	2.541,8	2.114,5	427,3

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.284,0	1.958,3	325,7
Barwert	2.918,8	2.481,9	436,9

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	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
Total	1.878,9	1.605,3

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	230,4	273,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	184,6	80,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	105,5	114,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	76,0	20,4
mehr als 2 bis 3 Jahre	231,0	185,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	115,0	111,2
mehr als 4 bis 5 Jahre	280,4	141,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	361,9	677,7
mehr als 10 Jahre	699,2	355,1
Total	2.284,0	1.958,3

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. €	200,2
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	798,9
mehr als 100 Mio. €	879,8
Total	1.878,9

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	265,1
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	911,8
mehr als 100 Mio. €	1.107,1
Total	2.284,0

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	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	-	-	-	-	-	-
Total	1.878,9	-	158,2	1.082,2	350,2	88,1	115,2	2,1	82,9	0,0

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	Gebietskörperschaft		Sonstige	
				regionale	örtliche		regionale	örtliche		
Deutschland	1.880,1	-	2,0	1.184,3	375,3	195,7	0,2	5,8	95,5	21,3
EU-Institutionen	103,9	-	-	-	-	-	103,9	-	-	-
Frankreich	1,0	-	-	-	1,0	-	-	-	-	-
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	2.284,0	-	141,0	1.324,3	396,3	195,7	104,1	5,8	95,5	21,3
-------	---------	---	-------	---------	-------	-------	-------	-----	------	------

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	
Total				

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	-	30,0	-	30,0
Total		30,0		30,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe	1.605,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	76,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	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

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

Umlaufende Pfandbriefe	1.958,3	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	81	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse	2.284,0	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	86,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8
§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung		
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF	54,5	Mio. €
EUR	329,2	Mio. €
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.