



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>	2.242,9	2.073,6	<b>169,3</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	3.096,2	2.620,9	<b>475,3</b>
davon Derivate	82,2	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	2.848,6	2.506,2	<b>342,4</b>

\*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.886,9	1.619,2	<b>267,7</b>
davon Derivate	-	-	
<b>Barwert</b>	2.518,0	2.107,7	<b>410,3</b>
davon Derivate	114,8	-	
<b>Risikobarwert <sup>(3)</sup></b>	2.331,3	1.987,9	343,4

\*) 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>	2.242,9	2.073,6	<b>169,3</b>
<b>Barwert</b>	3.096,2	2.620,9	<b>475,3</b>

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>	Überdeckung Vorjahr
<b>Nennwert</b>	1.886,9	1.619,2	<b>267,7</b>
<b>Barwert</b>	2.518,0	2.107,7	<b>410,3</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	162,7	314,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	79,6	226,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	48,1	45,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	101,5	94,0
mehr als 2 bis 3 Jahre	184,9	141,5
mehr als 3 bis 4 Jahre	243,8	183,4
mehr als 4 bis 5 Jahre	129,6	95,1
mehr als 5 bis 10 Jahre	339,8	670,4
mehr als 10 Jahre	952,9	303,1
<b>Total</b>	<b>2.242,9</b>	<b>2.073,6</b>

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr <sup>(2)</sup>
bis zu 6 Monate	85,1	81,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	98,5	59,7
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	75,6	117,6
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	29,3	51,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	209,3	138,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	179,7	131,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	173,3	183,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	343,4	546,2
mehr als 10 Jahre	692,7	309,9
<b>Total</b>	<b>1.886,9</b>	<b>1.619,2</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. €	193,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	647,4
mehr als 100 Mio.€	1.371,8
<b>Total</b>	<b>2.212,9</b>

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	204,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	787,5
mehr als 100 Mio.€	894,7
<b>Total</b>	<b>1.886,9</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	1.467,5	-	-	1.110,4	303,4	22,9	0,1	1,7	28,9	0,1
EU-Institutionen	5,0	-	-	-	-	-	5,0	-	-	-
Frankreich	25,4	-	-	-	0,4	-	25,0	-	-	-
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	315,0	-	155,0	130,0	5,0	25,0	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>2.212,9</b>	<b>0,0</b>	<b>440,0</b>	<b>1.265,4</b>	<b>328,8</b>	<b>47,9</b>	<b>100,1</b>	<b>1,7</b>	<b>28,9</b>	<b>0,1</b>

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

Länder	Gesamt	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.419,7	-	-	940,2	335,5	58,0	0,2	2,1	83,7	-
EU-Institutionen	81,4	-	-	-	-	-	81,4	-	-	-
Frankreich	25,8	-	25,0	-	0,8	-	-	-	-	-
Italien	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	175,0	-	100,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>1.886,9</b>	<b>-</b>	<b>175,0</b>	<b>1.080,2</b>	<b>356,3</b>	<b>58,0</b>	<b>131,6</b>	<b>2,1</b>	<b>83,7</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>			2.073,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			81,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			2.242,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			90,2	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			1,3	Mio. €
EUR			341,3	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

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

<b>Umlaufende Pfandbriefe<sup>(2)</sup></b>			1.619,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			76,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

<b>Deckungsmasse</b>			1.886,9	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			54,6	Mio. €
EUR			294,3	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