

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 ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	1.531,6	1.391,8	139,8
davon Derivate	-	-	
Barwert	1.876,7	1.654,0	222,7
davon Derivate	-	-	
Risikobarwert ⁽²⁾	1.576,5	1.464,8	111,7

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

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.627,8	1.507,9	119,9
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.267,8	1.962,6	305,2
davon Derivate	73,3	-	
Risikobarwert ⁽²⁾	2.092,1	1.875,9	216,2

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €) nach vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾	Überdeckung
Nennwert	1.531,6	1.391,8	139,8
Barwert	1.876,7	1.654,0	222,7

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	1.627,8	1.507,9	119,9
Barwert	2.267,8	1.962,6	305,2

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

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf ⁽¹⁾
bis zu 6 Monate	49,5	93,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	229,1	103,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	106,7	112,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	91,8	73,1
mehr als 2 bis 3 Jahre	70,9	132,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	19,8	230,7
mehr als 4 bis 5 Jahre	80,3	126,5
mehr als 5 bis 10 Jahre	195,3	286,8
mehr als 10 Jahre	688,2	233,2
Total	1.531,6	1.391,8

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr ⁽²⁾
bis zu 6 Monate	118,1	111,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	43,0	4,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	49,5	45,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	179,2	101,2
mehr als 2 bis 3 Jahre	151,5	183,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	57,9	130,0
mehr als 4 bis 5 Jahre	34,8	230,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	264,4	408,7
mehr als 10 Jahre	729,4	292,6
Total	1.627,8	1.507,9

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. €	150,6
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	501,5
mehr als 100 Mio. €	879,5
Total	1.531,6

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	168,4
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	464,9
mehr als 100 Mio. €	979,5
Total	1.612,8

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	1.166,6	-	-	876,8	249,4	18,0	0,1	0,8	21,5	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	70,0	-	-	70,0	-	-	-	-	-	-
Total	1.531,6	-	200,0	971,8	269,4	18,0	50,1	0,8	21,5	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	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.247,8	-	-	930,1	274,3	18,0	0,1	1,3	23,9	0,1
EU-Institutionen	45,0	-	-	-	-	-	45,0	-	-	-
Italien	5,0	-	5,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	275,0	-	200,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Spanien	20,0	-	-	20,0	-	-	-	-	-	-
Total	1.612,8	-	205,0	975,1	294,3	18,0	95,1	1,3	23,9	0,1

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	
Österreich	-	15,0	-	15,0
Total	-	15,0	-	15,0

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe ⁽¹⁾	1.391,8	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	95,7	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
Deckungsmasse	1.531,6	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,3	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung			§28 Abs. 1 Nr. 10
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite		
EUR	111,7	Mio. €	

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

Umlaufende Pfandbriefe ⁽²⁾	1.507,9	Mio. €	
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	84,7	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
Deckungsmasse	1.627,8	Mio. €	
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt	-	Mio. €	§28 Abs. 1 Nr. 8
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	90,6	%	§28 Abs. 1 Nr. 9
Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung			§28 Abs. 1 Nr. 10
Währung	Saldo aus Aktiv-/ Passivseite		
EUR	216,2	Mio. €	
GBP	0	Mio. €	

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.

⁽¹⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: - Mio. €

⁽²⁾ - Davon in den Eigenbestand übernommen: - Mio. €

⁽³⁾ - dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO