

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

2. Quartal 2019

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert	
		Q2 2019	Q2 2018	Q2 2019	Q2 2018	Q2 2019	Q2 2018
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	11.995,9	13.941,8	15.654,7	17.449,2	14.650,1	16.355,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	12.507,7	14.546,2	17.677,3	19.616,5	16.136,9	17.962,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	511,8	604,4	2.022,6	2.167,3	1.486,8	1.606,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,3	4,3	12,9	12,4	10,1	9,8
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	511,8	604,4	2.022,6	2.167,3		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,3	4,3	12,9	12,4		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
2. Quartal 2019

Öffentliche Pfandbriefe	Q2 2019		Q2 2018	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	568,0	310,1	196,5	627,9
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	549,9	377,2	1.411,0	342,9
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	777,2	441,1	558,0	232,3
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	628,0	264,8	549,9	379,9
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.680,6	538,0	1.404,6	838,8
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	997,9	737,1	1.676,0	560,2
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	692,4	480,3	1.043,2	678,8
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.387,6	4.614,4	3.632,9	5.337,2
> 10 Jahre	2.714,3	4.744,7	3.469,7	5.548,2

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 und 3 PfandBG

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
(nur ordentliche Deckung)**

2. Quartal 2019

Deckungswerte	Q2 2019 Mio. €	Q2 2018 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	778,6	892,2
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.000,0	2.451,5
Mehr als 100 Mio. €	9.729,1	11.027,5
Summe	12.507,7	14.371,2

Deckungswerte (nur ordentliche Deckung gem. § 20 Abs. 1 PfandBG)											
Staat	2. Quartal	Summe	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davongewährleistet von			
				Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2019	12.507,7	-	121,1	7.015,4	2.852,9	253,8	-	2.080,9	182,7	0,9
	Jahr 2018	14.371,2	-	789,2	7.417,1	3.195,3	523,1	-	2.199,8	245,8	0,9
Deutschland	Jahr 2019	10.366,9	-	51,1	6.998,2	2.822,4	235,8	-	75,8	182,7	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2019	172,3	-	-	-	-	172,3	-	-	-	-
	Jahr 2018	10.830,6	-	51,1	7.000,3	3.092,3	331,9	-	108,3	245,8	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2018	184,4	-	-	-	-	184,4	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2019	950,4	-	-	-	-	-	-	950,4	-	-
	Jahr 2018	1.024,6	-	-	-	-	-	-	1.024,6	-	-
Finnland	Jahr 2019	20,9	-	-	-	20,9	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	21,4	-	-	-	21,4	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2019	9,6	-	-	-	9,6	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	10,8	-	-	-	10,8	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	633,9	-	633,1	-	0,8	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2019	944,7	-	65,0	-	-	-	-	879,7	-	-
	Jahr 2018	981,9	-	65,0	-	-	-	-	916,9	-	-
Portugal	Jahr 2019	180,0	-	5,0	-	-	-	-	175,0	-	-
	Jahr 2018	190,0	-	40,0	-	-	-	-	150,0	-	-
Schweden	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	14,3	-	-	-	14,3	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	400,0	-	-	400,0	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2019	17,2	-	-	17,2	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	72,5	-	-	16,8	55,7	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2019	18,0	-	-	-	-	18,0	-	-	-	-
	Jahr 2018	87,2	-	-	-	-	87,2	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	104,0	-	-	-	-	104,0	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

2. Quartal 2019

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2				
Staat	2. Quartal	Summe Mio. €	davon	
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1 Mio. €	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2 Insgesamt Mio. €
		davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2019	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-
Deutschland	Jahr 2019	-	-	-
	Jahr 2018	175,0	-	175,0
Finnland	Jahr 2019	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-
Frankreich	Jahr 2019	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2019	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-
Schweiz	Jahr 2019	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-

Hinweis: In den weiteren Deckungswerten sind ausschließlich Forderungen mit der Bonitätsstufe 1 eingestellt

	30.06.2019		30.06.2018	
	Nominal	in %	Nominal	in %
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen in Mio EUR (§28 Abs. 3 Nr. 3)	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 8, 9 und 10 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
2. Quartal 2019

Öffentliche Pfandbriefe			Q2 2019	Q2 2018
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)		11.995,9	13.941,8
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9 (gewichteter Durchschnitt)	%		82,30	82,53
Deckungsmasse				
Deckungsmasse	(Mio. €)		12.507,7	14.546,2
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 20 Abs. 2 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)		-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9 (gewichteter Durchschnitt)	%		87,76	86,40
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD		-	-
	CHF		-	-
	CZK		-	-
	DKK		-	-
	GBP		-	-
	HKD		-	-
	JPY		817,7	746,9
	NOK		-	-
	SEK		-	14,6
	USD		22,2	86,8
AUD		-	-	