

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

1. Quartal 2019

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert	
		Q1 2019	Q1 2018	Q1 2019	Q1 2018	Q1 2019	Q1 2018
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	13.135,7	15.299,3	16.644,2	18.971,7	15.637,6	17.712,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	13.550,9	16.094,9	18.723,9	20.959,2	17.111,5	19.293,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	415,2	795,6	2.079,7	1.987,5	1.473,9	1.581,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		3,2	5,2	12,5	10,5	9,4	8,9
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	415,2	795,6	2.079,7	1.987,5		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		3,2	5,2	12,5	10,5		

* 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
1. Quartal 2019**

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2019		Q1 2018	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	1.190,1	389,9	1.272,2	2.013,0
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	697,9	475,8	456,0	467,0
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	794,5	265,5	1.190,0	279,2
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	608,1	500,3	697,9	394,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.643,4	531,4	1.402,0	866,2
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.103,2	746,9	1.640,9	481,7
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	801,8	560,3	1.114,3	774,7
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.416,4	4.829,5	3.859,5	5.239,4
> 10 Jahre	2.880,3	5.251,3	3.666,5	5.579,2

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

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

1. Quartal 2019

Deckungswerte	Q1 2019 Mio. €	Q1 2018 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	792,6	912,1
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.050,7	2.558,1
Mehr als 100 Mio. €	10.586,6	11.194,7
Summe	13.429,9	14.664,9

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

1. Quartal 2019

Deckungswerte (nur ordentliche Deckung gem. § 20 Abs. 1 PfandBG)											
Staat	1. Quartal	Summe		davon geschuldet von				davongewährleistet von			
		Mio. €	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörperschaften Mio. €	Örtliche Gebietskörperschaften Mio. €	Sonstige Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörperschaften Mio. €	Örtliche Gebietskörperschaften Mio. €	Sonstige Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2019	13.429,9	-	321,5	7.458,9	2.903,4	272,5	125,0	2.148,3	199,4	0,9
	Jahr 2018	14.664,9	-	727,7	7.183,7	3.611,3	531,9	-	2.354,5	254,9	0,9
Deutschland	Jahr 2019	10.470,7	-	51,1	7.013,4	2.872,9	254,5	-	78,5	199,4	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	11.171,8	-	51,1	7.092,7	3.208,8	340,7	-	222,7	254,9	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2018	186,9	-	-	-	-	186,9	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2019	986,8	-	-	-	-	-	-	986,8	-	-
	Jahr 2018	1.040,2	-	-	-	-	-	-	1.040,2	-	-
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	150,4	-	150,4	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	1.015,5	-	604,1	75,1	336,3	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2019	973,0	-	65,0	-	-	-	-	908,0	-	-
	Jahr 2018	1.006,6	-	65,0	-	-	-	-	941,6	-	-
Portugal	Jahr 2019	355,0	-	55,0	-	-	-	125,0	175,0	-	-
	Jahr 2018	157,5	-	7,5	-	-	-	-	150,0	-	-
Schweden	Jahr 2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	34,0	-	-	-	34,0	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2019	428,0	-	-	428,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2019	17,5	-	-	17,5	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2018	15,9	-	-	15,9	-	-	-	-	-	-
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

1. Quartal 2019

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2					
Staat	1. Quartal	Summe Mio. €	davon		
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1 Mio. €	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2 Mio. €	
		Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2			
		Insgesamt		davon	
				gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
		Mio. €			
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2019	121,0	-	121,0	10,0
	Jahr 2018	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2019	111,0	-	111,0	-
	Jahr 2018	1.430,0	-	1.430,0	-
Finnland	Jahr 2019	-	-	-	-
	Jahr 2018	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2019	10,0	-	10,0	10,0
	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

	31.03.2019		31.03.2018	
	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
1. Quartal 2019

Öffentliche Pfandbriefe			Q1 2019	Q1 2018
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)		13.135,7	15.299,3
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9 (gewichteter Durchschnitt)	%		83,91	83,37
Deckungsmasse				
Deckungsmasse	(Mio. €)		13.550,9	16.094,9
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)	%		87,27	77,94
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		794,2	732,5
	NOK		-	-
	SEK		-	34,7
	USD		21,5	19,2
AUD		-	-	