

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

3. Quartal 2018

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert	
		Q3 2018	Q3 2017	Q3 2018	Q3 2017	Q3 2018	Q3 2017
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	13.884,0	15.787,8	17.176,5	19.710,3	16.114,8	18.348,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	14.558,1	17.109,4	19.283,8	22.791,6	17.717,6	20.739,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	674,1	1.321,6	2.107,3	3.081,3	1.602,8	2.391,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,9	8,4	12,3	15,6	9,9	13,0
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	674,1	1.283,4	2.107,3	3.035,5		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,9	8,1	12,3	15,4		

* 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
3. Quartal 2018

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2018		Q3 2017	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	456,0	998,9	440,7	943,4
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.190,0	297,0	1.271,9	591,9
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	697,9	442,4	456,0	476,8
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	794,3	267,9	1.190,0	306,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.491,6	706,1	1.491,5	747,4
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.319,1	609,7	1.551,6	822,6
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	949,8	626,9	1.253,5	630,8
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.558,9	5.381,4	4.154,1	4.726,7
> 10 Jahre	3.426,4	5.227,8	3.978,5	7.863,8

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

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

3. Quartal 2018

Deckungswerte	Q3 2018 Mio. €	Q3 2017 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	864,4	1.014,3
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.201,6	3.227,7
Mehr als 100 Mio. €	10.945,1	12.867,4
Summe	14.011,1	17.109,4

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen
3. Quartal 2018

Deckungswerte (nur ordentliche Deckung gem. § 20 Abs. 1 PfandBG)											
Staat	3. 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 2018	14.011,1	-	634,3	7.215,1	3.088,3	496,4	125,0	2.213,8	237,3	0,9
	Jahr 2017	17.109,4	-	1.482,1	7.785,3	4.235,1	565,2	200,0	2.525,8	315,0	0,9
Deutschland	Jahr 2018	10.657,2	-	51,1	6.977,2	2.990,1	305,2	-	95,4	237,3	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2018	181,7	-	-	-	-	181,7	-	-	-	-
	Jahr 2017	11.815,3	-	51,1	7.350,6	3.415,6	374,0	-	308,1	315,0	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2017	198,8	-	-	-	-	198,8	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2018	1.018,0	-	-	-	-	-	-	1.018,0	-	-
	Jahr 2017	1.162,1	-	-	-	-	-	-	1.162,1	-	-
Finnland	Jahr 2018	21,4	-	-	-	21,4	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	22,5	-	-	-	22,5	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2018	9,6	-	-	-	9,6	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	10,8	-	-	-	10,8	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2018	478,9	-	478,2	-	0,7	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	1.964,1	-	1.241,0	165,5	557,6	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2018	990,4	-	65,0	-	-	-	-	925,4	-	-
	Jahr 2017	1.020,6	-	65,0	-	-	-	-	955,6	-	-
Portugal	Jahr 2018	340,0	-	40,0	-	-	-	125,0	175,0	-	-
	Jahr 2017	425,0	-	125,0	-	-	-	200,0	100,0	-	-
Schweden	Jahr 2018	9,7	-	-	-	9,7	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	77,7	-	-	-	77,7	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2018	221,0	-	-	221,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	60,1	-	-	60,1	-	-	-	-	-	-
Japan	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	216,5	-	-	116,4	100,1	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2018	73,7	-	-	16,9	56,8	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	143,5	-	-	92,7	50,8	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2018	87,2	-	-	-	-	87,2	-	-	-	-
	Jahr 2017	87,2	-	-	-	-	87,2	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2018	104,0	-	-	-	-	104,0	-	-	-	-
	Jahr 2017	104,0	-	-	-	-	104,0	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung
3. Quartal 2018

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2					
Staat	3. 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 2018	547,0	-	547,0	10,0
	Jahr 2017	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2018	537,0	-	537,0	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
Finnland	Jahr 2018	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2018	10,0	-	10,0	10,0
	Jahr 2017	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2018	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
Schweiz	Jahr 2018	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-

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

	30.09.2018		30.09.2017	
	Nominal	in %	Nominal	in %
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen in Mio EUR (§28 Abs. 3 Nr. 3)	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
3. Quartal 2018

Öffentliche Pfandbriefe			Q3 2018	Q3 2017
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)		13.884,0	15.787,8
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9 (gewichteter Durchschnitt)	%		82,43	87,62
Deckungsmasse	(Mio. €)		14.558,1	17.109,4
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)	%		83,85	85,25
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD		-	-
	CHF		-	-
	CZK		-	-
	DKK		-	-
	GBP		-	91,2
	HKD		-	-
	JPY		715,8	971,4
	NOK		-	-
	SEK		9,8	79,4
	USD		86,0	177,7
AUD		-	-	