

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

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

4. Quartal 2018

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert	
		Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017	Q4 2018	Q4 2017
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	13.605,0	15.447,2	16.897,5	19.245,5	15.891,0	17.888,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	14.036,9	16.730,8	18.984,5	22.535,9	17.383,7	20.537,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	431,9	1.283,6	2.087,0	3.290,4	1.492,7	2.649,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		3,2	8,3	12,4	17,1	9,4	14,8
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	431,9	1.283,6	2.087,0	3.290,4		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		3,2	8,3	12,4	17,1		

* 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
4. Quartal 2018**

Öffentliche Pfandbriefe	Q4 2018		Q4 2017	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	1.416,0	494,2	1.345,6	657,7
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	583,0	429,2	196,2	489,9
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	519,9	284,3	1.416,0	370,3
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	776,9	420,6	583,0	375,7
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.447,8	535,0	1.296,2	911,9
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.542,0	704,6	1.443,3	543,6
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	761,2	495,6	1.555,0	750,9
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.378,6	5.271,6	3.840,3	5.032,1
> 10 Jahre	3.179,6	5.401,8	3.771,6	7.598,7

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

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

4. Quartal 2018

Deckungswerte	Q4 2018 Mio. €	Q4 2017 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	799,8	1.002,9
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.137,6	3.071,1
Mehr als 100 Mio. €	10.953,5	12.656,8
Summe	13.890,9	16.730,8

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

4. Quartal 2018

Deckungswerte (nur ordentliche Deckung gem. § 20 Abs. 1 PfandBG)											
Staat	4. Quartal	Summe Mio. €	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung Mio. €	davon geschuldet von				davongewährleistet von			
				Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörper- schaften Mio. €	Örtliche Gebietskörper- schaften Mio. €	Sonstige Mio. €	Zentralstaat Mio. €	Regionale Gebietskörper- schaften Mio. €	Örtliche Gebietskörper- schaften Mio. €	Sonstige Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2018	13.890,9	-	579,2	7.452,5	2.994,2	369,5	125,0	2.151,7	217,9	0,9
	Jahr 2017	16.730,8	-	1.875,5	7.369,7	4.091,4	539,4	200,0	2.352,5	301,4	0,9
Deutschland	Jahr 2018	10.523,3	-	51,1	7.007,4	2.905,3	259,1	-	81,6	217,9	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2018	182,1	-	-	-	-	182,1	-	-	-	-
	Jahr 2017	11.370,6	-	51,1	7.073,6	3.326,5	348,2	-	268,9	301,4	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2017	186,7	-	-	-	-	186,7	-	-	-	-
Belgien	Jahr 2018	997,9	-	-	-	-	-	-	997,9	-	-
	Jahr 2017	1.050,8	-	-	-	-	-	-	1.050,8	-	-
Finnland	Jahr 2018	20,9	-	-	-	20,9	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	21,4	-	-	-	21,4	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2018	9,6	-	-	-	9,6	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	10,8	-	-	-	10,8	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2018	408,1	-	408,1	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	2.253,2	-	1.539,4	165,2	548,6	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2018	962,2	-	65,0	-	-	-	-	897,2	-	-
	Jahr 2017	997,8	-	65,0	-	-	-	-	932,8	-	-
Portugal	Jahr 2018	355,0	-	55,0	-	-	-	125,0	175,0	-	-
	Jahr 2017	520,0	-	220,0	-	-	-	200,0	100,0	-	-
Schweden	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	35,6	-	-	-	35,6	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2018	428,0	-	-	428,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	213,1	-	-	114,6	98,5	-	-	-	-	-
USA	Jahr 2018	75,5	-	-	17,1	58,4	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	66,3	-	-	16,3	50,0	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2018	61,9	-	-	-	-	61,9	-	-	-	-
	Jahr 2017	87,2	-	-	-	-	87,2	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2018	48,5	-	-	-	-	48,5	-	-	-	-
	Jahr 2017	104,0	-	-	-	-	104,0	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

4. Quartal 2018

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2					
Staat	4. 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	146,0	-	146,0	10,0
	Jahr 2017	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2018	136,0	-	136,0	-
	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

	31.12.2018		31.12.2017	
	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
4. Quartal 2018

Öffentliche Pfandbriefe			Q4 2018	Q4 2017
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)		13.605,0	15.447,2
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9 (gewichteter Durchschnitt)	%		82,16	83,32
Deckungsmasse				
Deckungsmasse	(Mio. €)		14.036,9	16.730,8
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)	%		86,64	85,40
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD		-	-
	CHF		-	-
	CZK		-	-
	DKK		-	-
	GBP		-	93,2
	HKD		-	-
	JPY		772,7	954,7
	NOK		-	-
	SEK		-	36,6
	USD		91,2	83,7
AUD		-	-	