

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
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(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**

<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	<b>Q4 2018</b>		<b>Q4 2017</b>	
	<b>Pfandbriefumlauf</b> Mio. €	<b>Deckungsmasse</b> Mio. €	<b>Pfandbriefumlauf</b> Mio. €	<b>Deckungsmasse</b> Mio. €
<b>Restlaufzeit:</b>				
<= 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**

<b>Deckungswerte</b>	<b>Q4 2018</b> Mio. €	<b>Q4 2017</b> 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
<b>Summe</b>	<b>13.890,9</b>	<b>16.730,8</b>

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. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	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
<b>Deutschland</b>	Jahr 2018	10.523,3	-	<b>51,1</b>	<b>7.007,4</b>	<b>2.905,3</b>	<b>259,1</b>	-	<b>81,6</b>	<b>217,9</b>	<b>0,9</b>
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	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	Jahr 2018	997,9	-	-	-	-	-	-	<b>997,9</b>	-	-
	Jahr 2017	1.050,8	-	-	-	-	-	-	1.050,8	-	-
<b>Finnland</b>	Jahr 2018	20,9	-	-	-	<b>20,9</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	21,4	-	-	-	21,4	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2018	9,6	-	-	-	<b>9,6</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	10,8	-	-	-	10,8	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	Jahr 2018	408,1	-	<b>408,1</b>	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	2.253,2	-	1.539,4	165,2	548,6	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	Jahr 2018	962,2	-	<b>65,0</b>	-	-	-	-	<b>897,2</b>	-	-
	Jahr 2017	997,8	-	65,0	-	-	-	-	932,8	-	-
<b>Portugal</b>	Jahr 2018	355,0	-	<b>55,0</b>	-	-	-	<b>125,0</b>	<b>175,0</b>	-	-
	Jahr 2017	520,0	-	220,0	-	-	-	200,0	100,0	-	-
<b>Schweden</b>	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	35,6	-	-	-	35,6	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	Jahr 2018	428,0	-	-	<b>428,0</b>	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	213,1	-	-	114,6	98,5	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	Jahr 2018	75,5	-	-	<b>17,1</b>	<b>58,4</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	66,3	-	-	16,3	50,0	-	-	-	-	-
<b>EU-Institutionen</b>	Jahr 2018	61,9	-	-	-	-	<b>61,9</b>	-	-	-	-
	Jahr 2017	87,2	-	-	-	-	87,2	-	-	-	-
<b>Übrige Staaten/Institutionen</b>	Jahr 2018	48,5	-	-	-	-	<b>48,5</b>	-	-	-	-
	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. €		
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2018	146,0	-	146,0	10,0
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2018	136,0	-	136,0	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	Jahr 2018	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2018	10,0	-	10,0	10,0
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	Jahr 2018	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	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		-	-	