

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

**Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte**

**2. Quartal 2018**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert	
		Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017	Q2 2018	Q2 2017
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	13.941,8	16.059,1	17.449,2	20.092,3	16.355,8	17.984,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	14.546,2	17.414,9	19.616,5	23.215,1	17.962,3	20.240,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	604,4	1.355,8	2.167,3	3.122,8	1.606,5	2.256,3
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,3	8,4	12,4	15,5	9,8	12,5
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	604,4	1.315,8	2.167,3	3.073,9		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		4,3	8,2	12,4	15,3		

\* 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 2018**

<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	<b>Q2 2018</b>		<b>Q2 2017</b>	
	<b>Pfandbriefumlauf</b> Mio. €	<b>Deckungsmasse</b> Mio. €	<b>Pfandbriefumlauf</b> Mio. €	<b>Deckungsmasse</b> Mio. €
<b>Restlaufzeit:</b>				
<= 0,5 Jahre	196,5	627,9	576,2	982,1
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.411,0	342,9	1.328,6	724,7
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	558,0	232,3	196,0	469,9
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	549,9	379,9	1.411,0	373,5
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	1.404,6	838,8	1.107,9	651,8
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.676,0	560,2	1.414,1	958,4
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	1.043,2	678,8	1.661,6	594,3
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	3.632,9	5.337,2	4.115,7	4.734,7
> 10 Jahre	3.469,7	5.548,2	4.248,0	7.925,5

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

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen  
2. Quartal 2018**

<b>Deckungswerte</b>	<b>Q2 2018</b> Mio. €	<b>Q2 2017</b> Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	892,2	1.060,9
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	2.451,5	3.228,0
Mehr als 100 Mio. €	11.027,5	13.126,0
<b>Summe</b>	<b>14.371,2</b>	<b>17.414,9</b>

Deckungswerte (nur ordentliche Deckung gem. § 20 Abs. 1 PfandBG)											
Staat	2. Quartal	Summe		davon geschuldet von				davongewährleistet von			
		Mio. €	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2018	14.371,2	-	789,2	7.417,1	3.195,3	523,1	-	2.199,8	245,8	0,9
	Jahr 2017	17.414,9	-	1.362,2	7.949,2	4.396,9	584,5	218,7	2.538,2	364,3	0,9
<b>Deutschland</b>	Jahr 2018	10.830,6	-	<b>51,1</b>	<b>7.000,3</b>	<b>3.092,3</b>	<b>331,9</b>	-	<b>108,3</b>	<b>245,8</b>	<b>0,9</b>
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2018	184,4	-				184,4				
	Jahr 2017	12.207,2	-	51,1	7.506,2	3.568,5	393,3	-	322,9	364,3	0,9
dav.: mit Haftung öff. Stellen	Jahr 2017	199,1	-	-	-	-	199,1	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	Jahr 2018	1.024,6	-	-	-	-	-	-	<b>1.024,6</b>	-	-
	Jahr 2017	1.171,4	-	-	-	-	-	-	1.171,4	-	-
<b>Finnland</b>	Jahr 2018	21,4	-	-	-	<b>21,4</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	22,5	-	-	-	22,5	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2018	10,8	-	-	-	<b>10,8</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	12,0	-	-	-	12,0	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	Jahr 2018	633,9	-	<b>633,1</b>	-	<b>0,8</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	1.827,0	-	1.101,1	166,3	559,6	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	Jahr 2018	981,9	-	<b>65,0</b>	-	-	-	-	<b>916,9</b>	-	-
	Jahr 2017	1.008,9	-	65,0	-	-	-	-	943,9	-	-
<b>Portugal</b>	Jahr 2018	190,0	-	<b>40,0</b>	-	-	-	-	<b>150,0</b>	-	-
	Jahr 2017	445,0	-	145,0	-	-	-	200,0	100,0	-	-
<b>Schweden</b>	Jahr 2018	14,3	-	-	-	<b>14,3</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	77,9	-	-	-	77,9	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	Jahr 2018	400,0	-	-	<b>400,0</b>	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	78,8	-	-	60,1	-	-	18,7	-	-	-
<b>Japan</b>	Jahr 2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	224,4	-	-	120,6	103,8	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	Jahr 2018	72,5	-	-	<b>16,8</b>	<b>55,7</b>	-	-	-	-	-
	Jahr 2017	148,6	-	-	96,0	52,6	-	-	-	-	-
<b>EU-Institutionen</b>	Jahr 2018	87,2	-	-	-	-	<b>87,2</b>	-	-	-	-
	Jahr 2017	87,2	-	-	-	-	87,2	-	-	-	-
<b>Übrige Staaten/Institutionen</b>	Jahr 2018	104,0	-	-	-	-	<b>104,0</b>	-	-	-	-
	Jahr 2017	104,0	-	-	-	-	104,0	-	-	-	-

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung**  
**2. Quartal 2018**

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 Mio. €	
				Insgesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	Jahr 2018	175,0	-	175,0	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	Jahr 2018	175,0	-	175,0	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	Jahr 2018	-	-	-	-
	Jahr 2017	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	Jahr 2018	-	-	-	-
	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

	30.06.2018		30.06.2017	
	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**  
**2. Quartal 2018**

Öffentliche Pfandbriefe			Q2 2018	Q2 2017
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)		13.941,8	16.059,1
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9 (gewichteter Durchschnitt)	%		82,53	87,43
Deckungsmasse	(Mio. €)		14.546,2	17.414,9
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)	%		86,40	85,35
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro  § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD		-	-
	CHF		-	-
	CZK		-	-
	DKK		-	-
	GBP		-	93,6
	HKD		-	-
	JPY		746,9	1.009,2
	NOK		-	-
	SEK		14,6	80,4
	USD		86,8	181,0
AUD		-	-	