

Kommunalgeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß §28 PfandBG
Stand: 30.06.2018



Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €)

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	2.257,7	1.941,6	316,1
davon Derivate	-	-	
Barwert	2.912,6	2.460,4	452,2
davon Derivate	119,1	-	
Risikobarwert *)	2.715,5	2.331,7	383,8

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.841,7	2.231,1	610,6
davon Derivate	-	-	
Barwert	3.583,0	2.826,7	756,3
davon Derivate	133,9	-	
Risikobarwert *)	3.354,5	2.676,2	678,3

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €) nach vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	2.257,7	1.941,6	316,1
Barwert	2.912,6	2.460,4	452,2

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	2.841,7	2.231,1	610,6
Barwert	3.583,0	2.826,7	756,3

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf
bis zu 6 Monate	345,7	322,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	100,4	81,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	71,2	59,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	125,7	117,6
mehr als 2 bis 3 Jahre	118,2	95,4
mehr als 3 bis 4 Jahre	117,7	111,1
mehr als 4 bis 5 Jahre	322,8	208,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	336,4	637,1
mehr als 10 Jahre	719,6	308,1
Total	2.257,7	1.941,6

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	132,1	161,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	133,5	123,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	287,4	322,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	131,0	86,3
mehr als 2 bis 3 Jahre	364,9	177,2
mehr als 3 bis 4 Jahre	123,2	95,4
mehr als 4 bis 5 Jahre	155,3	111,1
mehr als 5 bis 10 Jahre	721,6	634,7
mehr als 10 Jahre	792,7	519,2
Total	2.841,7	2.231,1

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio. €)

§28 Abs. 3 Nr. 1

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	251,7
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	849,9
mehr als 100 Mio. €	1.156,1
Total	2.257,7

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Stufen	Deckungsmasse
bis 10 Mio. €	261,0
mehr als 10 Mio. € bis 100 Mio. €	1.050,2
mehr als 100 Mio. €	1.530,5
Total	2.841,7

Verteilung der nennwertig als Deckung für Öffentliche Pfandbriefe verwendeten Forderungen auf die einzelnen Staaten, in denen der Schuldner bzw. die gewährleistende Stelle ihren Sitz hat - aufgeschlüsselt nach §28 Abs. 3 Nr. 2 (Mio. €)

§28 Abs. 3 Nr. 2

Länder	Gesamt	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	1.743,8	-	2,0	1.109,4	363,5	147,8	0,2	5,6	94,6	20,7
EU-Institutionen	113,9	-	-	-	-	-	113,9	-	-	-
Frankreich	51,0	-	50,0	-	1,0	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	150,0	-	75,0	25,0	-	-	50,0	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	2.257,7	-	191,0	1.249,4	384,5	147,8	164,1	5,6	94,6	20,7

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Länder	Gesamt	in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
			Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige
				regionale	örtliche			regionale	örtliche	
Deutschland	2.336,1	-	2,0	1.451,3	415,9	332,6	0,2	6,1	106,0	22,0
EU-Institutionen	149,9	-	-	-	-	-	149,9	-	-	-
Frankreich	56,7	-	55,0	-	1,7	-	-	-	-	-
Italien	39,0	-	39,0	-	-	-	-	-	-	-
Japan	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	100,0	-	75,0	25,0	-	-	-	-	-	-
Polen	25,0	-	25,0	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	115,0	-	-	115,0	-	-	-	-	-	-
Total	2.841,7	-	196,0	1.591,3	437,6	332,6	150,1	6,1	106,0	22,0

Weitere Deckungswerte gemäß §28 Abs. 1 Nr. 4 und 5 - Detaildarstellung (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 1	Geldforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.D. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Deutschland	-	5,0	-	5,0
Total	-	5,0	-	5,0

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 1	Geldforderungen nach §20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.D. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Total				

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe			1.941,6	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			80,8	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.257,7	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			54,7	Mio. €
EUR			334,6	Mio. €
GBP			0	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Umlaufende Pfandbriefe			2.231,1	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe			79,0	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse			2.841,7	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §20 Abs. 2 liegt			-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse			88,9	%

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung				
Währung			Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
CHF			61	Mio. €
EUR			623,6	
GBP			-0,1	Mio. €

§28 Abs. 1 Nr. 10

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.