

Transparenzbericht gem. § 28 PfandBG -vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell



Stichtag 30.06.2018

1	§ 28 Abs. 1 Nr. 1 bis 4 PfandBG - Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Pfandbriefe	3
1.1	Hypothekendarfandbriefe	3
1.2	Öffentliche Pfandbriefe	4
2	§28 Absatz 3 Nr.2 - Aufteilung der zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen nach Staaten	5

1 § 28 Abs. 1 Nr. 1 bis 4 PfandBG - Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Pfandbriefe

1.1 Hypothekendarlehen

Alle Werte in Mio. EUR. Die Angaben zum Vorjahr beziehen sich auf den 30.06.2017.

	Nominal Berichtsjahr	Nominal Vorjahr	Barwert Berichtsjahr	Barwert Vorjahr	Risikobar- wert Berichtsjahr	Risikobar- wert Vorjahr
Hypothekendarlehen	18.210,2	16.388,5	19.099,1	17.124,9	17.683,1	15.281,6
Deckungsmasse	20.389,8	18.155,4	22.878,9	20.467,3	21.326,6	18.391,1
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
davon weitere Deckungswerte (§ 19 Abs. 1 Nr. 1)	-	-	-	-	-	-
davon weitere Deckungswerte (§ 19 Abs. 1 Nr. 2)	-	-	-	-	-	-
davon weitere Deckungswerte (§ 19 Abs. 1 Nr. 3)	1.245,0	544,0	-	-	-	-
Überdeckung	2.179,6	1.766,9	3.779,8	3.342,4	3.643,5	3.109,5

Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Pfand- briefe	Deckungs- masse	davon: weitere Deckungswerte	Pfand- briefe	Deckungs- masse	davon: weitere Deckungswerte
bis einschl. 6 Monate	547,9	803,8	-	585,4	664,6	-
mehr als 6 Monate bis einschl. 1 Jahr	462,6	717,0	-	273,8	583,4	35,0
mehr als 1 Jahr bis einschl. 18 Monate	407,4	764,0	-	424,5	737,5	-
mehr als 18 Monate bis einschl. 2 Jahre	922,2	810,0	150,0	480,4	775,8	44,0
mehr als 2 Jahre bis einschl. 3 Jahre	975,8	1.679,7	190,0	1.363,1	1.371,4	-
mehr als 3 Jahre bis einschl. 4 Jahre	1.246,3	1.554,1	125,0	985,3	1.565,2	90,0
mehr als 4 Jahre bis einschl. 5 Jahre	1.461,5	1.530,2	160,0	1.270,5	1.436,7	90,0
mehr als 5 Jahre bis einschl. 10 Jahre	7.715,7	6.755,1	465,0	8.548,9	6.197,7	210,0
länger als 10 Jahre	4.470,8	5.775,9	155,0	2.456,6	4.823,1	75,0
Gesamt	18.210,2	20.389,8	1.245,0	16.388,5	18.155,4	544,0

1.2 Öffentliche Pfandbriefe

Alle Werte in Mio. EUR. Die Angaben zum Vorjahr beziehen sich auf den 30.06.2017.

	Nominal Berichtsjahr	Nominal Vorjahr	Barwert Berichts- jahr	Barwert Vorjahr	Risikobar- wert Berichtsjahr	Risikobar- wert Vorjahr
Öffentliche Pfandbriefe	9.194,6	9.995,4	10.724,8	11.600,9	9.996,7	10.468,7
Deckungsmasse	10.772,2	11.217,9	12.776,6	12.820,5	11.724,8	11.576,7
davon Derivate	-	-	-	-	-	-
davon weitere Deckungs- werte (§ 20 Abs. 2 Nr. 2)	-	7,0	-	-	-	-
Überdeckung	1.577,6	1.222,5	2.051,8	1.219,6	1.728,1	1.108,0

Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Pfandbriefe	Deckungs- masse	davon: weitere Deckungs- werte	Pfandbriefe	Deckungs- masse	davon: weite- re De- ckungswerte
bis einschl. 6 Monate	534,8	428,1	-	325,4	640,2	-
mehr als 6 Monate bis einschl. 1 Jahr	460,7	410,5	-	409,3	395,3	7,0
mehr als 1 Jahr bis einschl. 18 Monate	929,6	637,5	-	592,8	290,7	-
mehr als 18 Monate bis einschl. 2 Jahre	580,8	413,3	-	480,4	327,5	-
mehr als 2 Jahre bis einschl. 3 Jahre	749,4	597,5	-	1.573,4	1.043,5	-
mehr als 3 Jahre bis einschl. 4 Jahre	459,8	615,3	-	803,7	606,3	-
mehr als 4 Jahre bis einschl. 5 Jahre	485,8	670,5	-	535,1	627,7	-
mehr als 5 Jahre bis einschl. 10 Jahre	1.861,4	2.268,2	-	2.007,8	2.570,1	-
länger als 10 Jahre	3.132,3	4.731,3	-	3.267,5	4.716,6	-
Gesamt	9.194,6	10.772,2	-	9.995,4	11.217,9	7,0

2 §28 Absatz 3 Nr.2 - Aufteilung der zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen nach Staaten

Alle Werte in Mio. EUR. Die Angaben zum Vorjahr beziehen sich auf den 30.06.2017.

Bundesrepublik Deutschland	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	26,0	26,0	-	26,0	26,0	-
regionale Gebietskörperschaften	1.549,8	1.549,8	-	1.671,8	1.671,8	-
örtliche Gebietskörperschaften	6.749,4	6.725,4	24,0	7.104,5	7.073,0	31,5
Sonstige	1.011,6	1.011,6	-	957,6	957,6	-
Summe	9.336,8	9.312,8	24,0	9.759,9	9.728,4	31,5

Belgien	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	-	-	-	-	-	-
regionale Gebietskörperschaften	23,0	23,0	-	23,0	23,0	-
örtliche Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	23,0	23,0	-	23,0	23,0	-

Frankreich	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	40,0	40,0	-	-	-	-
regionale Gebietskörperschaften	7,0	7,0	-	26,8	26,8	-
örtliche Gebietskörperschaften	19,8	19,8	-	-	-	-
Sonstige	21,0	21,0	-	21,0	21,0	-
Summe	87,8	87,8	-	47,8	47,8	-

Italien	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	125,0	125,0	-	125,0	125,0	-
regionale Gebietskörperschaften	98,4	98,4	-	124,8	124,8	-
örtliche Gebietskörperschaften	22,2	22,2	8-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	245,6	245,6	-	249,8	249,8	-

Kanada	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	-	-	-	-	-	-
regionale Gebietskörperschaften	16,5	16,5	-	24,1	24,1	-
örtliche Gebietskörperschaften	5,3	5,3	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	21,8	21,8	-	24,1	24,1	-

Luxemburg	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	7,4	7,4	-	7,4	7,4	-
regionale Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
örtliche Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	7,4	7,4	-	7,4	7,4	-

Österreich	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	266,2	266,2	-	341,9	341,9	-
regionale Gebietskörperschaften	25,0	25,0	-	25,0	25,0	-
örtliche Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	291,2	291,2	-	366,9	366,9	-

Portugal	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	230,0	230,0	-	209,3	209,3	-
regionale Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
örtliche Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	230,0	230,0	-	209,3	209,3	-

Spanien	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	50,0	50,0	-	82,5	82,5	-
regionale Gebietskörperschaften	246,0	246,0	-	357,5	357,5	-
örtliche Gebietskörperschaften	25,0	25,0	-	-	-	-
Sonstige	-	-	-	-	-	-
Summe	321,0	321,0	-	440,0	440,0	-

EU-Institutionen	Berichtsjahr			Vorjahr		
	Gesamt	geschuldet	gewährleistet	Gesamt	geschuldet	gewährleistet
Zentralstaat	-	-	-	-	-	-
regionale Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
örtliche Gebietskörperschaften	-	-	-	-	-	-
Sonstige	207,6	207,6	-	82,7	82,7	-
Summe	207,6	207,6	-	82,7	82,7	-

Gesamtsumme	10.772,2	10.748,2	24,0	11.210,9	11.179,4	31,5
--------------------	-----------------	-----------------	-------------	----------	----------	------

Anmerkung: Die Angaben zum Vorjahr beziehen sich auf den 30.06.2017