



Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016
Hypothekendarfandbriefe	Mio. €	1.646,0	1.856,0	1.921,7	2.247,4	1.837,4	2.069,1
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	Mio. €	2.607,9	3.034,8	2.721,8	3.204,9	2.491,0	2.918,7
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	Mio. €	961,9	1.178,8	800,1	957,5	653,6	849,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		58,44	63,52	41,64	42,61	35,57	41,06

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 PfandBarwertV verwendet.

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016	Q3 2017	Q3 2016
Öffentlichen Pfandbriefe	Mio. €	988,4	1.302,4	1.161,3	1.554,4	1.106,1	1.685,3
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	Mio. €	1.650,3	2.312,9	1.694,7	2.397,9	1.662,1	2.485,3
darunter Derivate	Mio. €	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	Mio. €	661,9	1.010,5	533,4	843,5	556,1	800,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		66,96	77,59	45,93	54,26	50,27	47,47

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 PfandBarwertV verwendet.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen

Hypothekendarfandbriefe	Q3 2017		Q3 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Restlaufzeit:				
≤ 0,5 Jahre	42,5	491,4	102,0	139,8
> 0,5 Jahre und ≤ 1 Jahr	142,3	113,4	95,0	379,4
> 1 Jahr und ≤ 1,5 Jahre	439,7	205,3	42,5	473,3
> 1,5 Jahre und ≤ 2 Jahre	338,7	208,9	142,3	212,6
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	94,0	288,1	778,4	430,9
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	5,0	522,3	94,0	282,3
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	66,0	421,0	5,0	443,5
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	334,0	357,6	340,0	673,0
> 10 Jahre	183,8	-	256,8	-

Öffentliche Pfandbriefe	Q3 2017		Q3 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Restlaufzeit:				
≤ 0,5 Jahre	15,0	243,6	101,0	293,9
> 0,5 Jahre und ≤ 1 Jahr	8,0	618,8	191,0	266,5
> 1 Jahr und ≤ 1,5 Jahre	313,7	545,5	15,0	226,8
> 1,5 Jahre und ≤ 2 Jahre	137,0	14,5	8,0	891,6
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	108,2	50,7	450,7	400,6
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	55,0	27,5	108,2	55,9
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	35,0	52,9	55,0	27,3
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	241,0	96,7	167,0	145,9
> 10 Jahre	75,5	-	206,5	4,6

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarfandbriefe und Öffentliche Pfandbriefe

Hypothekendarfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3	Q3 2017 Mio. €	Q3 2016 Mio. €
Deckungsaktiva	95,0	70,0

Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2	Q3 2017 Mio. €	Q3 2016 Mio. €
Deckungsaktiva	-	-

Zur Deckung von Hypothekendarfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen

Deckungswerte	Q3 2017 Mio. €	Q3 2016 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	4,8	4,5
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	22,7	28,2
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	470,2	562,8
Mehr als 10 Mio. €	2.015,2	2.369,3
Summe	2.512,9	2.964,8

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen

Deckungswerte	Q3 2017 Mio. €	Q3 2016 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	128,9	207,4
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	1.521,4	2.105,5
Mehr als 100 Mio. €	-	-
Summe	1.650,3	2.312,9

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

	3. Quartal	Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand 5% der Forderung beträgt	
		Insgesamt	davon															
			Wohnwirtschaftlich							Gewerblich								
			Insgesamt	davon					Insgesamt	davon								
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2017	2.512,9	494,5	4,8	0,1	489,6	-	-	2.018,3	1.159,3	681,6	-	177,5	-	-	-	-	
	Jahr 2016	2.964,8	532,6	7,1	0,3	525,3	-	-	2.432,2	1.367,1	824,9	-	240,2	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2017	1.403,6	494,5	4,8	0,1	489,6	-	-	909,0	233,3	526,3	-	149,5	-	-	-	-	
	Jahr 2016	1.588,6	532,6	7,1	0,3	525,3	-	-	1.056,0	316,8	527,0	-	212,2	-	-	-	-	
Belgien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Bulgarien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Dänemark	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Estland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Finnland	Jahr 2017	324,2	-	-	-	-	-	-	324,2	220,6	75,6	-	28,0	-	-	-	-	
	Jahr 2016	365,8	-	-	-	-	-	-	365,8	262,2	75,6	-	28,0	-	-	-	-	
Frankreich	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Griechenland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Großbritannien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Irland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Italien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Lettland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Litauen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Luxemburg	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Malta	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Niederlande	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Österreich	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Polen	Jahr 2017	44,0	-	-	-	-	-	-	44,0	44,0	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	140,5	-	-	-	-	-	-	140,5	44,0	96,5	-	-	-	-	-	-	
Portugal	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Rumänien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Schweden	Jahr 2017	741,1	-	-	-	-	-	-	741,1	661,4	79,7	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	869,9	-	-	-	-	-	-	869,9	744,1	125,8	-	-	-	-	-	-	
Slowakei	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Slowenien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Spanien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mind. 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

	3. Quartal	Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand 5% der Forderung beträgt	
		Insgesamt	Wohnwirtschaftlich								Gewerblich							
			Insgesamt	davon					Insgesamt	davon								
				Wohnungen	Einfamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze			
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Staat	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Tschechien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Ungarn	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Zypern	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Island	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Liechtenstein	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Norwegen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Schweiz	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Japan	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Kanada	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
USA	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Sonstige OECD-Staaten	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
EU-Institutionen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	



Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt

Staat	3. Quartal	Deckungswerte										Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von				Summe	davon				Summe	davon			
				Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2017	1.650,3	28,3	116,3	423,9	1.018,0	92,0	28,3	95,5	55,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	2.312,9	32,2	235,2	364,7	1.595,4	117,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Deutschland	Jahr 2017	1.536,2	28,3	91,3	423,9	929,0	92,0	28,3	95,5	55,7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	2.159,2	32,2	185,2	364,7	1.491,7	117,6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Belgien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Bulgarien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Dänemark	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Estland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Finnland	Jahr 2017	113,0	-	25,0	-	88,0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	152,4	-	50,0	-	102,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Frankreich	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Griechenland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Großbritannien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Irland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Italien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Lettland	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Litauen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Luxemburg	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Malta	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Niederlande	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Österreich	Jahr 2017	1,0	-	-	-	1,0	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	1,3	-	-	-	1,3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Polen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Portugal	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Rumänien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Schweden	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Slowakei	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Slowenien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Spanien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Tschechien	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Ungarn	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Zypern	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Island	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Liechtenstein	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Norwegen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Schweiz	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	



Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderung, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt

Staat	3. Quartal	Deckungswerte										Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	In der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	davon geschuldet von				davon gewährleistet von				Summe	davon				Summe	davon			
				Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Japan	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Kanada	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
USA	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Sonstige OECD-Staaten	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
EU-Institutionen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Übrige Staaten/Institutionen	Jahr 2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	Jahr 2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

3. Quartal 2017

		Weitere Deckungswerte für Hypothekendarstellungen nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3				
		Summe	davon			Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3 i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2 Ingesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen	
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - all		95,0	-	-	-	95,0
Jahr 2017		95,0	-	-	-	95,0
Jahr 2016		70,0	-	-	-	70,0
Deutschland		95,0	-	-	-	95,0
Jahr 2017		95,0	-	-	-	95,0
Jahr 2016		70,0	-	-	-	70,0
Belgien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Bulgarien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Dänemark		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Estland		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Finnland		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Frankreich		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Griechenland		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Großbritannien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Irland		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Italien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Lettland		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Litauen		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Luxemburg		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Malta		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Niederlande		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Österreich		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Polen		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Portugal		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Rumänien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Schweden		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Slowakei		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Slowenien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Spanien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Tschechien		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Ungarn		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Zypern		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Island		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Liechtenstein		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Norwegen		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Schweiz		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Japan		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Kanada		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
USA		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
EU-Institutionen		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-
Übrige Staaten/Inseln		-	-	-	-	-
Jahr 2017		-	-	-	-	-
Jahr 2016		-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung

3. Quartal 2017

		Weitere Deckungswerte für öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr.2				
		Summe	davon			
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2		
				Ingesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - al		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Deutschland		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Belgien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Bulgarien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Dänemark		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Estland		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Finnland		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Frankreich		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Griechenland		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Großbritannien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Irland		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Italien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Lettland		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Litauen		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Luxemburg		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Malta		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Niederlande		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Österreich		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Polen		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Portugal		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Rumänien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Schweden		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Slowakei		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Slowenien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Spanien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Tschechien		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Ungarn		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Zypern		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Island		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Liechtenstein		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Norwegen		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Schweiz		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Japan		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Kanada		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
USA		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Sonstige OECD-Sta		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
EU-Institutionen		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-
Übrige Staaten/Ins		Jahr 2017	-	-	-	-
		Jahr 2016	-	-	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

3. Quartal 2017

Hypothekendarfandbriefe

		Q3 2017	Q3 2016
Umlaufende Darfandbriefe	(Mio. €)	1.646,0	1.856,0
davon Anteil festverzinslicher Darfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	98,82	93,56
Deckungsmasse	(Mio. €)	2.607,9	3.034,8
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten § 28 Abs. 1 Nr. 7	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	42,26	40,00
Nettobarwert nach § 6 Darfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	754,9	869,9
	USD	-	-
...	-	-	
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 1 Nr. 11	Jahre	4,9	4,4
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	47,90	46,77
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-

Öffentliche Darfandbriefe

		Q3 2017	Q3 2016
Umlaufende Darfandbriefe	(Mio. €)	988,4	1.302,4
davon Anteil festverzinslicher Darfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	100,00	100,00
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.650,3	2.312,9
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 übersteigen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	74,54	83,58
Nettobarwert nach § 6 Darfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
...	-	-	