



§ 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG)

Transparenzvorschriften für Öffentliche Pfandbriefe

Quartalsmeldung zum 30. September 2019

A) § 28 Abs. 1 Nr. 1 bis Nr. 3 PfandBG

1. Im Umlauf befindliche Öffentliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
Deckungswerte**	291,9	305,0	313,3	316,3	326,1	317,8
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Öffentliche Pfandbriefe	170,0	180,0	215,1	217,8	228,0	228,3
Überdeckung in %	71,7	69,4	45,6	45,2	43,0	39,2

* dynamisches Verfahren

** einschließlich weiterer Deckungswerte gemäß § 20 Abs. 2 PfandBG

2. Laufzeitstruktur der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der verwendeten Deckungswerte (Nennwert):

	Deckungswerte*	Deckungswerte*	Öffentliche Pfandbriefe	Öffentliche Pfandbriefe
	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
bis zu 6 Monate	4,9	20,0	35,0	10,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	0,0	0,0	25,0	0,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	45,0	20,0	0,0	35,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,0	30,0	0,0	25,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	105,0	20,0	0,0	0,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	72,0	165,0	0,0	0,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	50,0	0,0	0,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	20,0	0,0	50,0	50,0
über 10 Jahre	25,0	0,0	60,0	60,0
Summe	291,9	305,0	170,0	180,0

* einschließlich weiterer Deckungswerte gemäß § 20 Abs. 2 PfandBG



B) § 28 Abs. 1 Nr. 4 und Nr. 5 PfandBG

Weitere Deckungswerte (Nennwert) für Pfandbriefe nach Ländern / Registrierstaaten:

	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
Deutschland		
Ausgleichsforderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0,0	0,0
Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	4,9	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	0,0	0,0
Summe Deutschland	4,9	0,0
Gesamtsumme	4,9	0,0

C) § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen (Nennwert):

	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	0,0	10,0
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	287,0	295,0
mehr als 100 Mio €	0,0	0,0
Summe	287,0	305,0



D) § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen (Nennwert) nach der Art des Schuldners bzw. der gewährleistenden Stelle und deren Sitz (Staat):

	Öffentliche Deckungswerte			
	Q III 2019 Mio €		Q III 2018 Mio €	
	geschuldet	gewährleistet	geschuldet	gewährleistet
Deutschland				
Staat	29,9	0,0	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	240,0	0,0	285,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe Deutschland	269,9	0,0	285,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0	0,0	0,0
EU-Institutionen				
Staat	0,0	0,0	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	22,0	0,0	0,0	0,0
Summe EU-Institutionen	22,0	0,0	0,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0	0,0	0,0
Luxemburg				
Staat	0,0	0,0	20,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe Luxemburg	0,0	0,0	20,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0	0,0	0,0
Teilsomme geschuldet / gewährleistet	291,9	0,0	305,0	0,0
Gesamtsumme	291,9		305,0	



E) § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen auf öffentliche Forderungen (Nennwert):

	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
Deutschland		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Deutschland	0,0	0,0
Gesamtsumme	0,0	0,0

Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der öffentlichen Forderung beträgt (Nennwert):

	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
Deutschland		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Deutschland	0,0	0,0
Gesamtsumme	0,0	0,0



F) § 28 Abs. 1 Nr. 8 bis Nr. 10 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und den dafür verwendeten Deckungswerten:

	Q III 2019	Q III 2018
Zinsstruktur nach § 28 Abs. 1 Nr. 9 PfandBG		
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,0%	100,0%
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	100,0%	100,0%
Überschreitungen nach § 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG		
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen über der Begrenzung nach § 20 Abs. 2 PfandBG in Mio €	0,0	0,0
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio € (§ 28 Abs. 1 Nr. 10 PfandBG)	-	-

G) § 4 Abs. 1 PfandBG

	Q III 2019 Mio €	Q III 2018 Mio €
Deckungswerte (Nennwert) für sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)	10,0	10,0