

§ 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG) Transparenzvorschriften für Öffentliche Pfandbriefe

Quartalsmeldung zum 31. März 2018

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 I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €	Q I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €	Q I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €
Deckungswerte**	295,0	295,0	311,7	316,1	313,7	318,5
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Öffentliche Pfandbriefe	205,0	205,0	246,1	253,7	257,2	266,2
Überdeckung in %	43,9	43,9	26,7	24,6	22,0	19,7

* 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 I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €	Q I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €
bis zu 6 Monate	0,0	10,0	25,0	0,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	20,0	0,0	10,0	0,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	0,0	0,0	25,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,0	20,0	35,0	10,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	30,0	20,0	25,0	35,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	50,0	20,0	0,0	25,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	175,0	50,0	0,0	0,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	175,0	50,0	50,0
über 10 Jahre	0,0	0,0	60,0	60,0
Summe	295,0	295,0	205,0	205,0

* 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 I 2018 Mio €	Q I 2017 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	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	0,0	0,0
Summe Deutschland	0,0	0,0
Gesamtsumme	0,0	0,0

C) § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

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

	Q I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	10,0	10,0
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	285,0	285,0
mehr als 100 Mio €	0,0	0,0
Summe	295,0	295,0

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 I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €
Deutschland		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	275,0	295,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Deutschland	275,0	295,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Luxemburg		
Staat	20,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Luxemburg	20,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Gesamtsumme	295,0	295,0

E) § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

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

	Q I 2018 Mio €	Q I 2017 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 I 2018 Mio €	Q I 2017 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 I 2018	Q I 2017
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 I 2018 Mio €	Q I 2017 Mio €
Deckungswerte (Nennwert) für sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)	10,0	10,0