



## § 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG)

### Transparenzvorschriften für Öffentliche Pfandbriefe

#### Quartalsmeldung zum 30. September 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 III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € | Q III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € | Q III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € |
| Deckungswerte**         | 305,0               | 295,0               | 316,3               | 314,5               | 317,8               | 316,4               |
| davon Derivate          | 0,0                 | 0,0                 | 0,0                 | 0,0                 | 0,0                 | 0,0                 |
| Öffentliche Pfandbriefe | 180,0               | 205,0               | 217,8               | 249,1               | 228,3               | 260,6               |
| Überdeckung in %        | 69,4                | 43,9                | 45,2                | 26,3                | 39,2                | 21,5                |

\* 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 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € | Q III 2018<br>Mio €     | Q III 2017<br>Mio €     |
| bis zu 6 Monate                      | 20,0                | 0,0                 | 10,0                    | 0,0                     |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten  | 0,0                 | 0,0                 | 0,0                     | 25,0                    |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 20,0                | 20,0                | 35,0                    | 10,0                    |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren   | 30,0                | 0,0                 | 25,0                    | 0,0                     |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren     | 20,0                | 50,0                | 0,0                     | 60,0                    |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren     | 165,0               | 20,0                | 0,0                     | 0,0                     |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren     | 50,0                | 155,0               | 0,0                     | 0,0                     |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren    | 0,0                 | 50,0                | 50,0                    | 50,0                    |
| über 10 Jahre                        | 0,0                 | 0,0                 | 60,0                    | 60,0                    |
| <b>Summe</b>                         | <b>305,0</b>        | <b>295,0</b>        | <b>180,0</b>            | <b>205,0</b>            |

\* 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 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>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                 |
| <b>Gesamtsumme</b>                                                             | <b>0,0</b>          | <b>0,0</b>          |

## C) § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

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

|                                    | Q III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € |
|------------------------------------|---------------------|---------------------|
| bis einschließlich 10 Mio €        | 10,0                | 10,0                |
| mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio € | 295,0               | 285,0               |
| mehr als 100 Mio €                 | 0,0                 | 0,0                 |
| <b>Summe</b>                       | <b>305,0</b>        | <b>295,0</b>        |

## 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 2018<br>Mio €       | Q III 2017<br>Mio € |
| <b>Deutschland</b>                                                  |                           |                     |
| Staat                                                               | 0,0                       | 0,0                 |
| Regionale Gebietskörperschaft                                       | 285,0                     | 275,0               |
| Örtliche Gebietskörperschaft                                        | 0,0                       | 0,0                 |
| Sonstige Schuldner                                                  | 0,0                       | 0,0                 |
| Summe Deutschland                                                   | 285,0                     | 275,0               |
| Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | 0,0                       | 0,0                 |
| <b>Luxemburg</b>                                                    |                           |                     |
| Staat                                                               | 20,0                      | 20,0                |
| Regionale Gebietskörperschaft                                       | 0,0                       | 0,0                 |
| Örtliche Gebietskörperschaft                                        | 0,0                       | 0,0                 |
| Sonstige Schuldner                                                  | 0,0                       | 0,0                 |
| Summe Luxemburg                                                     | 20,0                      | 20,0                |
| Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | 0,0                       | 0,0                 |
| <b>Gesamtsumme</b>                                                  | <b>305,0</b>              | <b>295,0</b>        |



E) § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

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

|                               | Q III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € |
|-------------------------------|---------------------|---------------------|
| <b>Deutschland</b>            |                     |                     |
| 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                 |
| <b>Gesamtsumme</b>            | <b>0,0</b>          | <b>0,0</b>          |

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

|                               | Q III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € |
|-------------------------------|---------------------|---------------------|
| <b>Deutschland</b>            |                     |                     |
| 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                 |
| <b>Gesamtsumme</b>            | <b>0,0</b>          | <b>0,0</b>          |



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

**Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und den dafür verwendeten Deckungswerten:**

|                                                                                                            | Q III 2018 | Q III 2017 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------------|
| <b>Zinsstruktur nach § 28 Abs. 1 Nr. 9 PfandBG</b>                                                         |            |            |
| Anteil festverzinslicher Pfandbriefe                                                                       | 100,0%     | 100%       |
| Anteil festverzinslicher Deckungsmasse                                                                     | 100,0%     | 100%       |
| <b>Überschreitungen nach § 28 Abs. 1 Nr. 8 PfandBG</b>                                                     |            |            |
| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen über der Begrenzung nach § 20 Abs. 2 PfandBG in Mio € | 0,0        | 0,0        |
| <b>Weitere Kennzahlen</b>                                                                                  |            |            |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio € (§ 28 Abs. 1 Nr. 10 PfandBG)   | -          | -          |

## G) § 4 Abs. 1 PfandBG

|                                                                         | Q III 2018<br>Mio € | Q III 2017<br>Mio € |
|-------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|
| Deckungswerte (Nennwert) für sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) | 10,0                | 10,0                |