



## § 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG)

### Transparenzvorschriften für Öffentliche Pfandbriefe

#### Quartalsmeldung zum 31. Dezember 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 IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
Deckungswerte**	305,5	270,0	321,5	280,4	333,2	288,1
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Öffentliche Pfandbriefe	170,0	170,0	209,7	208,4	221,5	221,8
Überdeckung in %	79,7	58,8	53,3	34,5	50,4	29,9

\* 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 IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
bis zu 6 Monate	13,5	20,0	60,0	0,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	45,0	20,0	0,0	0,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	20,0	20,0	0,0	60,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	10,0	0,0	0,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	155,0	20,0	0,0	0,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	27,0	180,0	0,0	0,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	20,0	0,0	0,0	0,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	0,0	50,0	50,0
über 10 Jahre	25,0	0,0	60,0	60,0
<b>Summe</b>	<b>305,5</b>	<b>270,0</b>	<b>170,0</b>	<b>170,0</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:**

	<b>Q IV 2019 Mio €</b>	<b>Q IV 2018 Mio €</b>
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	13,5	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	0,0	0,0
Summe Deutschland	13,5	0,0
<b>Gesamtsumme</b>	<b>13,5</b>	<b>0,0</b>

C) § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

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

	<b>Q IV 2019 Mio €</b>	<b>Q IV 2018 Mio €</b>
bis einschließlich 10 Mio €	0,0	10,0
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	292,0	260,0
mehr als 100 Mio €	0,0	0,0
<b>Summe</b>	<b>292,0</b>	<b>270,0</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 IV 2019 Mio €		Q IV 2018 Mio €	
	geschuldet	gewährleistet	geschuldet	gewährleistet
<b>Deutschland</b>				
Staat	38,5	0,0	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	240,0	0,0	250,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe Deutschland	278,5	0,0	250,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>EU-Institutionen</b>				
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	27,0	0,0	0,0	0,0
Summe EU-Institutionen	27,0	0,0	0,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Luxemburg</b>				
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
<b>Teilsomme geschuldet / gewährleistet</b>	<b>305,5</b>	<b>0,0</b>	<b>270,0</b>	<b>0,0</b>
<b>Gesamtsumme</b>	<b>305,5</b>		<b>270,0</b>	



E) § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

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

	<b>Q IV 2019 Mio €</b>	<b>Q IV 2018 Mio €</b>
<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):**

	<b>Q IV 2019 Mio €</b>	<b>Q IV 2018 Mio €</b>
<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 IV 2019	Q IV 2018
<b>Zinsstruktur nach § 28 Abs. 1 Nr. 9 PfandBG</b>		
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,0%	100,0%
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	100,0%	100,0%
<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 IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
Deckungswerte (Nennwert) für sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)	10,0	10,0