



§ 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG)

Transparenzvorschriften für Öffentliche Pfandbriefe

Quartalsmeldung zum 30. September 2020

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 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Deckungswerte**	147,0	291,9	154,0	313,3	156,3	326,1
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Öffentliche Pfandbriefe	90,0	170,0	120,6	215,1	129,8	228,0
Überdeckung in %	63,3	71,7	27,7	45,6	20,4	43,0

* 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 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
bis zu 6 Monate	45,0	4,9	0,0	35,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	20,0	0,0	0,0	25,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	30,0	45,0	0,0	0,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	25,0	20,0	0,0	0,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	7,0	105,0	0,0	0,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,0	72,0	0,0	0,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	20,0	0,0	10,0	0,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	20,0	65,0	50,0
über 10 Jahre	0,0	25,0	15,0	60,0
Summe	147,0	291,9	90,0	170,0

* 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 2020 Mio €	Q III 2019 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	4,9
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013	0,0	0,0
Summe Deutschland	0,0	4,9
Gesamtsumme	0,0	4,9

C) § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	7,0	0,0
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	140,0	287,0
mehr als 100 Mio €	0,0	0,0
Summe	147,0	287,0



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 2020 Mio €		Q III 2019 Mio €	
	geschuldet	gewährleistet	geschuldet	gewährleistet
Deutschland				
Staat	25,0	0,0	29,9	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	122,0	0,0	240,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe Deutschland	147,0	0,0	269,9	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	0,0	0,0	22,0	0,0
Summe EU-Institutionen	0,0	0,0	22,0	0,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0	0,0	0,0
Teilsomme geschuldet / gewährleistet	147,0	0,0	291,9	0,0
Gesamtsumme	147,0		291,9	



E) § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 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 2020 Mio €	Q III 2019 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 2020	Q III 2019
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 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Deckungswerte (Nennwert) für sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)	5,5	10,0