

## § 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG) Transparenzvorschriften für Öffentliche Pfandbriefe

### Quartalsmeldung zum 30. Juni 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 II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €	Q II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €	Q II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €
Deckungswerte**	305,0	295,0	317,8	315,3	318,5	318,1
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Öffentliche Pfandbriefe	205,0	205,0	244,5	249,4	254,8	262,9
Überdeckung in %	48,8	43,9	30,0	26,4	25,0	21,0

\* 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 II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €	Q II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €
bis zu 6 Monate	0,0	0,0	35,0	0,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	20,0	0,0	0,0	0,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	20,0	0,0	0,0	35,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,0	20,0	60,0	0,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	30,0	20,0	0,0	60,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	80,0	50,0	0,0	0,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	135,0	80,0	0,0	0,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	125,0	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>205,0</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 II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €
<b>Deutschland</b>		
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 II 2018 Mio €	Q II 2017 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 II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €
<b>Deutschland</b>		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	285,0	295,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Deutschland	285,0	295,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
<b>Luxemburg</b>		
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
<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 II 2018 Mio €	Q II 2017 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 II 2018 Mio €	Q II 2017 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 II 2018	Q II 2017
<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 II 2018 Mio €	Q II 2017 Mio €
Deckungswerte (Nennwert) für sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)	10,0	10,0