Natixis Pfandbriefbank AG
Im Trutz Frankfurt 55
60322 Frankfurt
Telefon: +49 69 971530
Telefax:
E-Mail:
Internet: www.pfb.natixis.com

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

1. Quartal 2020

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1 2020	Q1 2019	Q1 2020	Q1 2019	Q1 2020	Q1 2019
Hypothekenpfandbriefe	(Mio. €)	1.320,5	1.332,4	1.343,1	1.345,4	1.391,7	1.393,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.460,6	1.538,9	1.546,1	1.625,6	1.584,7	1.654,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	140,1	206,5	203,0	280,2	193,0	260,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		10,6	15,5	15,1	20,8	13,9	18,7
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	140,1	206,5	203,0	280,2		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		10,6	15,5	15,1	20,8		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
1. Quartal 2020

Hypothekenpfandbriefe	Q1 2020		Q1 2019	
Restlaufzeit:	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €	**Pfandbriefumlauf** Mio. €	**Deckungsmasse** Mio. €
<= 0,5 Jahre	23,0	3,6	134,9	69,5
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	88,0	55,7	114,5	97,6
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	103,5	5,6	23,0	45,6
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	290,0	97,6	88,0	134,2
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	10,0	243,1	406,0	125,1
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	265,0	402,9	10,0	267,6
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	260,0	173,8	265,0	336,2
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	281,0	478,3	291,0	463,1
> 10 Jahre	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 a PfandBG, § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG und § 28 Abs. 4 Nr. 1 a PfandBG

Zur Deckung von Hypothekenpfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
1. Quartal 2020

Deckungswerte	**Q1 2020** Mio. €	**Q1 2019** Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	-	-
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	-	-
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	82,7	129,1
Mehr als 10 Mio. €	1.212,9	1.244,3
Summe	1.295,6	1.373,4

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 b, c und Nr. 2 PfandBG

Zur Deckung von Hypothekenpfandbriefen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

1. Quartal 2020

		Deckungswerte														Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
		Insgesamt	davon														
			Wohnwirtschaftlich						Gewerblich								
			Insgesamt	davon					Insgesamt	davon							
				Eigentums-wohnungen	Ein- und Zwei-familien-häuser	Mehrfamilien-häuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		Bürogebäude	Handels-gebäude	Industrie-gebäude	Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten	Bauplätze		
Staat	**1. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	1.295,6	86,0	-	-	86,0	-	-	1.209,6	768,4	389,9	-	51,3	-	-	-	-
	Jahr 2019	1.373,4	83,6	-	-	83,6	-	-	1.289,9	752,4	474,0	-	63,5	-	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	457,5	81,3	-	-	81,3	-	-	376,3	304,2	72,1	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	431,9	83,6	-	-	83,6	-	-	348,3	252,8	67,9	-	27,7	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2020	727,6	4,7	-	-	4,7	-	-	722,9	439,1	232,4	-	51,3	-	-	-	-
	Jahr 2019	837,6	-	-	-	-	-	-	837,6	487,3	314,4	-	35,8	-	-	-	-
Italien	Jahr 2020	75,3	-	-	-	-	-	-	75,3	25,1	50,2	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	61,3	-	-	-	-	-	-	61,3	12,2	49,1	-	-	-	-	-	-
Portugal	Jahr 2020	24,6	-	-	-	-	-	-	24,6	-	24,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	24,6	-	-	-	-	-	-	24,6	-	24,6	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2020	10,7	-	-	-	-	-	-	10,7	-	10,7	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	18,1	-	-	-	-	-	-	18,1	-	18,1	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 6 PfandBG

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekenpfandbriefe

1. Quartal 2020

		Weitere Deckungswerte für Hypothekenpfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr.1, Nr. 2 und 3 PfandBG				
		Summe	davon			
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	**Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2**		**Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3**
				Insgesamt	davon	
					gedeckte Schuld-verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Staat	**1. Quartal**	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	165,0	-	-	-	165,0
	Jahr 2019	165,5	-	-	-	165,5
Deutschland	Jahr 2020	165,0	-	-	-	165,0
	Jahr 2019	165,5	-	-	-	165,5

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 7, 8, 9, 10 und 11 PfandBG und § 28 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten
1. Quartal 2020

Hypothekenpfandbriefe

		Q1 2020	Q1 2019
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	1.320,5	1.332,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	95,2	81,4
Deckungsmasse	(Mio. €)	1.460,6	1.538,9
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten § 28 Abs. 1 Nr. 7	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	41,3	34,3
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning) § 28 Abs. 1 Nr. 11	Jahre	3,1	3,0
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf § 28 Abs. 2 Nr. 3	%	58,1	58,1
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe -	%	-	-