

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG (Deutschland)

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2015

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1/2015	Q1/2014	Q1/2015	Q1/2014	Q1/2015	Q1/2014
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.381,9	3.085,7	3.567,8	3.250,7	3.145,8	2.889,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-346,7	-208,3	-51,0	-8,1
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.342,4	4.005,1	4.732,5	4.408,9	4.255,7	3.934,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-299,9	-95,3	114,2	195,5
Überdeckung	(Mio. €)	960,5	919,4	1.164,6	1.158,2	1.109,9	1.045,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		28,4	29,8	32,6	35,6	35,3	36,2

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der statische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 1 und § 6 PfandBarwertV verwendet.

Anmerkung:

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG (Deutschland)

**Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques)
und der dafür verwendeten Deckungsmassen**

1. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe	Q1/2015		Q1/2014	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	13,5	1.374,9	26,0	1.082,8
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	486,0	100,1	246,2	65,0
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	8,0	147,4	13,5	247,1
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	418,9	96,4	431,3	150,9
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	458,9	452,8	541,5	225,8
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	131,3	238,5	388,0	498,4
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	631,8	263,4	134,6	194,3
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	485,7	734,7	711,6	515,7
> 10 Jahre	747,7	934,1	592,9	1.025,1

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1, 8, 9 und 10 PfandBG (Deutschland)

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2015

		Q1/2015	Q1/2014
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.381,9	3.085,7
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	85,3%	69,3%
Deckungsmasse		4.342,4	4.005,1
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung nach Art. 12-5 Abs.4 des Gesetzes vom 05/04/1993 über den Finanzsektor (Luxemburg) überschreiten	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinsliche Deckungswerte	(in %)	76,0%	71,5%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-0,2	
CHF	(Mio. €)	-50,4	
EUR	(Mio. €)	976,6	
GBP	(Mio. €)	-2,6	
JPY	(Mio. €)	-28,6	
NOK	(Mio. €)	5,2	
USD	(Mio. €)	209,9	

Weitere Deckungswerte *)

1. Quartal

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr. 2

	Q1/2015 Mio. €	Q1/2014 Mio. €
Deckungsaktiva	145,0	125,0
davon		
Deutschland	25,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Frankreich	100,0	100,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	100,0	100,0
Schweden	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Spanien	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-

* in Werten unter § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandbriefBG enthalten
und kalkuliert nach Art. 12-5 Abs.3 des Gesetzes vom 05/04/1993 über den Finanzsektor (Luxemburg)

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen (Lettres de Gage publiques) verwendete Forderungen
sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen**

1. Quartal

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.03.2015	4.342,4	406,5	949,0	862,2	2.124,7	-	-	-	-	-
	31.03.2014	4.005,1	507,5	578,6	732,6	2.186,4	-	-	-	-	-
Deutschland	31.03.2015	1.731,0	26,0	398,0	24,2	1.282,8	-	-	-	-	-
	31.03.2014	1.157,3	16,7	15,0	-	1.125,6	-	-	-	-	-
Frankreich	31.03.2015	161,8	-	-	-	161,8	-	-	-	-	-
	31.03.2014	157,7	-	-	-	157,7	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.03.2015	71,9	-	-	-	71,9	-	-	-	-	-
	31.03.2014	28,5	-	-	-	28,5	-	-	-	-	-
Irland	31.03.2015	81,8	-	-	-	81,8	-	-	-	-	-
	31.03.2014	76,3	-	-	-	76,3	-	-	-	-	-
Italien	31.03.2015	136,1	108,2	27,9	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	139,0	102,8	21,8	-	14,5	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.03.2015	62,5	-	-	-	62,5	-	-	-	-	-
	31.03.2014	292,6	-	-	-	292,6	-	-	-	-	-
Niederlande	31.03.2015	139,4	-	-	-	139,4	-	-	-	-	-
	31.03.2014	169,0	50,0	-	-	119,0	-	-	-	-	-
Österreich	31.03.2015	95,7	43,7	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.03.2014	141,4	39,4	87,0	-	15,0	-	-	-	-	-

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Polen	31.03.2015	188,0	188,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	169,0	169,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Schweden	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	31.03.2015	70,0	-	-	-	70,0	-	-	-	-	-
	31.03.2014	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
Tschechien	31.03.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	40,0	40,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
Japan	31.03.2015	17,4	-	-	17,4	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	16,5	-	-	16,5	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.03.2015	258,0	-	208,0	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.03.2014	223,9	-	173,9	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	31.03.2015	1.109,3	10,6	278,1	820,5	-	-	-	-	-	-
	31.03.2014	956,6	9,7	280,9	666,1	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.03.2015	100,8	-	-	-	100,8	-	-	-	-	-
	31.03.2014	88,5	-	-	-	88,5	-	-	-	-	-
Supranational	31.03.2015	88,8	-	-	-	38,8	-	-	-	-	-
	31.03.2014	85,1	50,0	-	-	35,1	-	-	-	-	-