

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2014

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2014	Q4/2013	Q4/2014	Q4/2013	Q4/2014	Q4/2013
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.193,5	3.183,0	3.424,2	3.328,5	3.026,8	2.993,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-270,5	-170,2	-6,9	19,7
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.048,0	4.108,0	4.445,1	4.506,9	4.004,3	4.048,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-185,4	-64,2	143,2	213,4
Überdeckung	(Mio. €)	854,5	925,0	1.020,9	1.178,4	977,5	1.055,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		26,8	29,1	29,8	35,4	32,3	35,3

* 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**

4. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe	Q4/2014		Q4/2013	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	80,4	1.310,3	131,5	1.104,2
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	425,5	161,7	34,5	120,6
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	6,0	122,0	225,0	153,6
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	442,0	207,5	423,0	141,2
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	494,5	356,8	448,0	312,2
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	164,1	313,6	450,4	345,7
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	221,8	153,2	173,8	348,0
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	613,7	507,1	709,1	551,7
> 10 Jahre	745,5	915,8	587,7	1.030,9

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2014

		Q4/2014	Q4/2013
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.193,5	3.183,0
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	78,8%	73,9%
Deckungsmasse		4.048,0	4.108,0
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 %)	75,4%	80,3%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-0,2	
CHF	(Mio. €)	-43,2	
EUR	(Mio. €)	771,0	
GBP	(Mio. €)	6,0	
JPY	(Mio. €)	3,6	
NOK	(Mio. €)	5,0	
USD	(Mio. €)	235,2	

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 und 5 PfandBG (Deutschland)

Weitere Deckungswerte *)

4. Quartal

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr. 2		
	Q4/2014 Mio. €	Q4/2013 Mio. €
Deckungsaktiva	145,0	175,0
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	50,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	50,0
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**

4. 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	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.12.2014	4.048,0	442,6	628,8	745,3	2.231,3	-	-	-	-	-
	31.12.2013	4.108,0	529,5	594,2	734,4	2.249,9	-	-	-	-	-
Deutschland	31.12.2014	1.419,7	47,5	130,6	-	1.241,7	-	-	-	-	-
	31.12.2013	1.148,4	17,3	16,2	-	1.115,0	-	-	-	-	-
Frankreich	31.12.2014	160,8	-	-	-	160,8	-	-	-	-	-
	31.12.2013	159,1	-	-	-	159,1	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.12.2014	47,0	-	-	-	47,0	-	-	-	-	-
	31.12.2013	27,7	-	-	-	27,7	-	-	-	-	-
Irland	31.12.2014	76,1	-	-	-	76,1	-	-	-	-	-
	31.12.2013	76,1	-	-	-	76,1	-	-	-	-	-
Italien	31.12.2014	128,0	103,3	24,7	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	138,8	102,6	21,8	-	14,5	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.12.2014	271,0	-	-	-	271,0	-	-	-	-	-
	31.12.2013	321,5	-	-	-	321,5	-	-	-	-	-
Niederlande	31.12.2014	136,0	-	-	-	136,0	-	-	-	-	-
	31.12.2013	185,6	71,0	-	-	114,6	-	-	-	-	-
Österreich	31.12.2014	94,7	42,7	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.12.2013	142,9	40,9	87,0	-	15,0	-	-	-	-	-

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**

4. Quartal

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Polen	31.12.2014	169,1	169,1	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	167,6	167,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Schweden	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
Spanien	31.12.2014	95,0	-	-	-	95,0	-	-	-	-	-
	31.12.2013	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
Tschechien	31.12.2014	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	40,0	40,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
Japan	31.12.2014	15,5	-	-	15,5	-	-	-	-	-	-
	31.12.2013	16,2	-	-	16,2	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.12.2014	234,3	-	184,3	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.12.2013	223,8	-	173,8	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	31.12.2014	992,0	-	252,2	729,8	9,9	-	-	-	-	-
	31.12.2013	973,7	10,1	295,5	668,1	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.12.2014	94,4	-	-	-	94,4	-	-	-	-	-
	31.12.2013	88,5	-	-	-	88,5	-	-	-	-	-
Supranational	31.12.2014	84,4	50,0	-	-	34,4	-	-	-	-	-
	31.12.2013	84,5	50,0	-	-	34,5	-	-	-	-	-