

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2014**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2014	Q3/2013	Q3/2014	Q3/2013	Q3/2014	Q3/2013
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.248,2	3.298,8	3.454,1	3.449,3	3.079,3	3.082,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-245,0	-215,6	12,4	14,9
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.044,8	4.203,6	4.378,8	4.620,1	3.940,3	4.113,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-160,2	-106,5	155,7	201,4
Überdeckung	(Mio. €)	796,6	904,8	924,7	1.170,8	861,0	1.030,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,5	27,4	26,8	33,9	28,0	33,4

\* 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**

**3. Quartal**

Öffentliche Pfandbriefe	Q3/2014		Q3/2013	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	260,9	1.209,7	126,8	1.063,3
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	13,5	286,6	51,0	146,6
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	441,3	157,6	250,5	75,7
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	8,0	110,0	13,5	253,9
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	867,6	387,7	460,2	258,7
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	220,7	354,6	843,3	354,4
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	21,5	154,6	225,7	416,8
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	649,4	476,3	700,0	585,4
> 10 Jahre	765,4	907,8	627,8	1.048,8

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2014**

		Q3/2014	Q3/2013
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.248,2	3.298,8
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	76,6%	76,1%
<b>Deckungsmasse</b>		4.044,8	4.203,6
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung nach Art. 12-5 Abs.3 des Gesetzes vom 05/04/1993 über den Finanzsektor (Luxemburg) überschreiten	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinsliche Deckungswerte	(in %)	74,6%	84,5%
<b>Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)</b>			
CAD	(Mio. €)	-0,4	
CHF	(Mio. €)	-47,8	
EUR	(Mio. €)	701,9	
GBP	(Mio. €)	14,5	
JPY	(Mio. €)	3,7	
NOK	(Mio. €)	5,6	
USD	(Mio. €)	183,6	

**Weitere Deckungswerte \*)**

**3. Quartal**

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

	Q3/2014 Mio. €	Q3/2013 Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>145,0</b>	<b>175,0</b>
davon		
<b>Deutschland</b>	<b>25,0</b>	<b>25,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Frankreich</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	100,0	100,0
<b>Schweden</b>	<b>0,0</b>	<b>50,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	50,0
<b>Spanien</b>	<b>20,0</b>	<b>0,0</b>
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**

**3. 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	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	30.09.2014	4.044,8	425,2	600,2	775,4	2.244,0	-	-	-	-	-
	30.09.2013	4.203,6	538,6	589,7	754,3	2.321,0	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	30.09.2014	1.399,9	18,1	105,6	-	1.276,3	-	-	-	-	-
	30.09.2013	1.241,2	18,3	16,2	-	1.206,8	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	30.09.2014	160,8	-	-	-	160,8	-	-	-	-	-
	30.09.2013	161,3	-	-	-	161,3	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	30.09.2014	37,6	-	-	-	37,6	-	-	-	-	-
	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Irland</b>	30.09.2014	78,8	-	-	-	78,8	-	-	-	-	-
	30.09.2013	81,1	-	-	-	81,1	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	30.09.2014	144,7	103,2	23,8	-	17,7	-	-	-	-	-
	30.09.2013	157,4	102,7	40,2	-	14,5	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	30.09.2014	287,0	-	-	-	287,0	-	-	-	-	-
	30.09.2013	324,3	-	-	-	324,3	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	30.09.2014	133,3	-	-	-	133,3	-	-	-	-	-
	30.09.2013	184,2	71,0	-	-	113,2	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	30.09.2014	94,7	42,7	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-
	30.09.2013	98,1	43,1	45,0	-	10,0	-	-	-	-	-

		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	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Polen</b>	30.09.2014	171,5	171,5	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	173,0	173,0	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Portugal</b>	30.09.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	30.09.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	30.09.2014	95,0	-	-	-	95,0	-	-	-	-	-
	30.09.2013	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	30.09.2014	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>	30.09.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	65,0	40,0	-	-	25,0	-	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	30.09.2014	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
	30.09.2013	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	30.09.2014	16,7	-	-	16,7	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	18,2	-	-	18,2	-	-	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	30.09.2014	240,3	-	190,3	50,0	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	227,3	-	177,3	50,0	-	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	30.09.2014	962,1	9,8	243,5	708,7	-	-	-	-	-	-
	30.09.2013	1.007,7	10,5	311,0	686,1	-	-	-	-	-	-
<b>Sonstige OECD-Staaten</b>	30.09.2014	92,7	-	-	-	92,7	-	-	-	-	-
	30.09.2013	89,4	-	-	-	89,4	-	-	-	-	-
<b>Supranational</b>	30.09.2014	86,2	50,0	-	-	36,2	-	-	-	-	-
	30.09.2013	50,0	50,0	-	-	-	-	-	-	-	-