

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2014

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2014	Q2/2013	Q2/2014	Q2/2013	Q2/2014	Q2/2013
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.073,3	3.341,5	3.230,1	3.488,9	2.849,8	3.101,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-238,5	-244,9	-32,4	-10,4
Deckungsmasse	(Mio. €)	3.913,8	4.243,4	4.285,8	4.650,5	3.832,0	4.127,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-125,5	-133,5	155,6	186,6
Überdeckung	(Mio. €)	840,5	901,9	1.055,7	1.161,7	982,2	1.025,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27,3	27,0	32,7	33,3	34,5	33,1

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

Anmerkung:

Die NORD/LB CFB weist daraufhin, dass die Nominalwerte der Deckungsmassen die sichernde Überdeckung [§4 (1) PfandBG] und Liquiditätsreserve [§4 (1a) PfandBG] beinhalten.

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

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

2. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe	Q2/2014		Q2/2013	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	34,5	1.123,4	54,0	1.014,4
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	227,0	218,0	131,1	239,9
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	436,4	140,6	34,5	111,9
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	6,0	113,8	234,7	178,0
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	844,6	322,3	458,9	258,2
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	146,0	425,7	866,6	333,1
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	73,5	163,9	151,0	412,1
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	608,2	480,8	774,3	634,9
> 10 Jahre	697,1	925,2	636,5	1.061,0

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2014

		Q2/2014	Q2/2013
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.073,3	3.341,5
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	75,8%	81,3%
Deckungsmasse		3.913,8	4.243,4
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 %)	75,8%	88,5%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*			
CAD	(Mio. €)	-0,3	
CHF	(Mio. €)	-47,4	
EUR	(Mio. €)	804,2	
GBP	(Mio. €)	13,0	
JPY	(Mio. €)	3,0	
NOK	(Mio. €)	5,4	
USD	(Mio. €)	204,3	

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

Anmerkung:

Die NORD/LB CFB weist daraufhin, dass die Nominalwerte der Deckungsmassen die sichernde Überdeckung [§4 (1) PfandBG] und Liquiditätsreserve [§4 (1a) PfandBG] beinhalten.

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

Weitere Deckungswerte *)

2. Quartal

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

	Q2/2014 Mio. €	Q2/2013 Mio. €
Deckungsaktiva	125,0	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

* 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**
2. 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	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	30.06.2014	3.913,8	421,7	573,6	736,5	2.182,0	-	-	-	-	-
	30.06.2013	4.243,4	500,3	606,0	760,3	2.376,7	-	-	-	-	-
Deutschland	30.06.2014	1.297,1	17,4	75,0	-	1.204,7	-	-	-	-	-
	30.06.2013	1.244,7	18,5	16,2	-	1.209,9	-	-	-	-	-
Frankreich	30.06.2014	159,3	-	-	-	159,3	-	-	-	-	-
	30.06.2013	161,8	-	-	-	161,8	-	-	-	-	-
Großbritannien	30.06.2014	31,8	-	-	-	31,8	-	-	-	-	-
	30.06.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Irland	30.06.2014	78,0	-	-	-	78,0	-	-	-	-	-
	30.06.2013	82,3	-	-	-	82,3	-	-	-	-	-
Italien	30.06.2014	139,3	102,9	22,0	-	14,5	-	-	-	-	-
	30.06.2013	157,8	102,4	40,9	-	14,5	-	-	-	-	-
Luxemburg	30.06.2014	293,8	-	-	-	293,8	-	-	-	-	-
	30.06.2013	328,8	-	-	-	328,8	-	-	-	-	-
Niederlande	30.06.2014	126,3	-	-	-	126,3	-	-	-	-	-
	30.06.2013	182,6	71,0	-	-	111,6	-	-	-	-	-
Österreich	30.06.2014	93,1	41,1	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-
	30.06.2013	98,8	43,8	45,0	-	10,0	-	-	-	-	-
Polen	30.06.2014	170,7	170,7	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	173,2	173,2	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	30.06.2014	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	30.06.2013	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Schweden	30.06.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
Spanien	30.06.2014	95,0	-	-	-	95,0	-	-	-	-	-
	30.06.2013	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-

		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	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Tschechien	30.06.2014	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	30.06.2013	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	30.06.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
Norwegen	30.06.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	46,4	-	-	-	46,4	-	-	-	-	-
Schweiz	30.06.2014	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
	30.06.2013	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
Japan	30.06.2014	16,6	-	-	16,6	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	18,5	-	-	18,5	-	-	-	-	-	-
Kanada	30.06.2014	225,8	-	175,8	50,0	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	232,5	-	182,5	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	30.06.2014	943,2	9,5	263,8	669,9	-	-	-	-	-	-
	30.06.2013	1.024,5	11,3	321,4	691,8	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten		30.06.2014	88,9	-	-	88,9	-	-	-	-	-
		30.06.2013	90,9	-	-	90,9	-	-	-	-	-
Supranational		30.06.2014	86,1	50,0	-	36,1	-	-	-	-	-
		30.06.2013	50,0	50,0	-	-	-	-	-	-	-