

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2014

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1/2014	Q1/2013	Q1/2014	Q1/2013	Q1/2014	Q1/2013
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.085,7	3.440,4	3.250,7	3.641,6	2.889,0	3.200,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-208,3	-273,3	-8,1	-44,3
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.005,1	4.370,0	4.408,9	4.808,0	3.934,9	4.246,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-95,3	-224,1	195,5	120,8
Überdeckung	(Mio. €)	919,4	929,6	1.158,2	1.166,3	1.045,9	1.045,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		29,8	27,0	35,6	32,0	36,2	32,7

* 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**

1. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe		Q1/2014		Q1/2013	
Restlaufzeit:		Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 1 Jahr		272,2	1.147,8	161,0	1.324,9
> 1 Jahr und ≤ 5 Jahre		1.508,9	1.316,5	1.749,8	1.349,9
davon	> 1 Jahr und ≤ 2 Jahre	444,8	398,0	286,1	224,7
	> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	541,5	225,8	491,8	404,7
	> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	388,0	498,4	554,6	235,4
	> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	134,6	194,3	417,3	485,1
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre		711,6	515,7	897,7	632,1
> 10 Jahre		592,9	1.025,1	631,9	1.063,2

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

Weitere Deckungswerte *)

1. Quartal

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

	Q1/2014 Mio. €	Q1/2013 Mio. €
Deckungsaktiva	125,0	175,0

* 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				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.03.2014	4.005,1	507,5	578,6	732,6	2.186,4	-	-	-	-	-
	31.03.2013	4.370,0	504,3	646,0	782,9	2.436,8	-	-	-	-	-
Deutschland	31.03.2014	1.157,3	16,7	15,0	-	1.125,6	-	-	-	-	-
	31.03.2013	1.184,6	19,5	16,2	-	1.148,9	-	-	-	-	-
Belgien	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Australien	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	26,1	-	-	-	26,1	-	-	-	-	-
Dänemark	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Estland	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	31.03.2014	157,7	-	-	-	157,7	-	-	-	-	-
	31.03.2013	164,1	-	-	-	164,1	-	-	-	-	-
Griechenland	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.03.2014	28,5	-	-	-	28,5	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Irland	31.03.2014	76,3	-	-	-	76,3	-	-	-	-	-
	31.03.2013	86,7	-	-	-	86,7	-	-	-	-	-
Italien	31.03.2014	139,0	102,8	21,8	-	14,5	-	-	-	-	-
	31.03.2013	156,4	102,8	41,4	-	12,1	-	-	-	-	-

		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
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Lettland	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Litauen	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.03.2014	292,6	-	-	-	292,6	-	-	-	-	-
	31.03.2013	335,9	-	-	-	335,9	-	-	-	-	-
Neuseeland	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	73,8	-	-	-	73,8	-	-	-	-	-
Niederlande	31.03.2014	169,0	50,0	-	-	119,0	-	-	-	-	-
	31.03.2013	183,1	71,0	-	-	112,1	-	-	-	-	-
Österreich	31.03.2014	141,4	39,4	87,0	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.03.2013	101,1	46,1	45,0	-	10,0	-	-	-	-	-
Polen	31.03.2014	169,0	169,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	178,2	178,2	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	31.03.2014	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.03.2013	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Rumänien	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
Slowakei	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	31.03.2014	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
	31.03.2013	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
Tschechien	31.03.2014	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	31.03.2013	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	31.03.2014	40,0	40,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
Zypern	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Island	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Liechtenstein	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Norwegen	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	49,6	-	-	-	49,6	-	-	-	-	-

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Schweiz	31.03.2014	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
	31.03.2013	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
Japan	31.03.2014	16,5	-	-	16,5	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	20,3	-	-	20,3	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.03.2014	223,9	-	173,9	50,0	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	236,3	-	186,3	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	31.03.2014	956,6	9,7	280,9	666,1	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	1.081,5	6,7	357,0	712,6	5,1	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.03.2014	88,5	-	-	-	88,5	-	-	-	-	-
	31.03.2013	91,9	-	-	-	91,9	-	-	-	-	-
Supranational	31.03.2014	85,1	50,0	-	-	35,1	-	-	-	-	-
	31.03.2013	50,0	50,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige	31.03.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-