

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2013

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2013	Q4/2012	Q4/2013	Q4/2012	Q4/2013	Q4/2012
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.183,0	3.505,5	3.328,5	3.678,3	2.993,5	3.222,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-170,2	-321,3	19,7	-77,5
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.108,0	4.225,8	4.506,9	4.647,8	4.048,9	4.120,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-64,2	-243,0	213,4	110,9
Überdeckung	(Mio. €)	925,0	720,2	1.178,4	969,5	1.055,5	897,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		29,1	20,5	35,4	26,4	35,3	27,9

* 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**

4. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe		Q4/2013		Q4/2012	
Restlaufzeit:		Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 1 Jahr		166,0	1.224,8	54,0	1.308,8
> 1 Jahr und ≤ 5 Jahre		1.720,2	1.300,6	1.825,2	1.142,6
davon	> 1 Jahr und ≤ 2 Jahre	648,0	294,7	167,3	261,9
	> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	448,0	312,2	732,2	313,0
	> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	450,4	345,7	455,5	319,3
	> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	173,8	348,0	470,1	248,4
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre		709,1	551,7	994,0	750,7
> 10 Jahre		587,7	1.030,9	632,4	1.023,7

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

Weitere Deckungswerte *)

4. Quartal

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

	Q4/2013 Mio. €	Q4/2012 Mio. €
Deckungsaktiva	175,0	225,0

* 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	31.12.2013	4.108,0	529,5	594,2	734,4	2.249,9	-	-	-	-	-
	31.12.2012	4.225,8	422,6	632,5	767,0	2.403,7	-	-	-	-	-
Deutschland	31.12.2013	1.148,4	17,3	16,2	-	1.115,0	-	-	-	-	-
	31.12.2012	1.194,3	19,3	16,2	-	1.158,7	-	-	-	-	-
Belgien	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Australien	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	26,7	-	-	-	26,7	-	-	-	-	-
Dänemark	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Estland	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	31.12.2013	159,1	-	-	-	159,1	-	-	-	-	-
	31.12.2012	163,7	-	-	-	163,7	-	-	-	-	-
Griechenland	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.12.2013	27,7	-	-	-	27,7	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Irland	31.12.2013	76,1	-	-	-	76,1	-	-	-	-	-
	31.12.2012	89,8	-	-	-	89,8	-	-	-	-	-

		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
Italien	31.12.2013	138,8	102,6	21,8	-	14,5	-	-	-	-	-
	31.12.2012	156,0	103,1	40,7	-	12,1	-	-	-	-	-
Lettland	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Litauen	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.12.2013	321,5	-	-	-	321,5	-	-	-	-	-
	31.12.2012	323,8	-	-	-	323,8	-	-	-	-	-
Neuseeland	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	24,3	-	-	-	24,3	-	-	-	-	-
Niederlande	31.12.2013	185,6	71,0	-	-	114,6	-	-	-	-	-
	31.12.2012	176,9	71,0	-	-	105,9	-	-	-	-	-
Österreich	31.12.2013	142,9	40,9	87,0	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.12.2012	100,7	45,7	45,0	-	10,0	-	-	-	-	-
Polen	31.12.2013	167,6	167,6	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	141,6	141,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	31.12.2013	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.12.2012	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Rumänien	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	31.12.2013	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.12.2012	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
Slowakei	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	31.12.2013	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
	31.12.2012	170,0	-	-	-	170,0	-	-	-	-	-
Tschechien	31.12.2013	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	31.12.2012	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	31.12.2013	40,0	40,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
Zypern	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Island	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Liechtenstein	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

		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
Norwegen	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	102,8	-	-	-	102,8	-	-	-	-	-
Schweiz	31.12.2013	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
	31.12.2012	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
Japan	31.12.2013	16,2	-	-	16,2	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	21,6	-	-	21,6	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.12.2013	223,8	-	173,8	50,0	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	231,5	-	181,5	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	31.12.2013	973,7	10,1	295,5	668,1	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	1.056,4	11,9	349,1	695,4	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.12.2013	88,5	-	-	-	88,5	-	-	-	-	-
	31.12.2012	90,5	-	-	-	90,5	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	31.12.2013	84,5	50,0	-	-	34,5	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	31.12.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-