

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2013

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2013	Q3/2012	Q3/2013	Q3/2012	Q3/2013	Q3/2012
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.298,8	3.569,6	3.449,3	3.655,9	3.082,4	3.266,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-215,6	-418,9	14,9	-96,2
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.203,6	4.255,4	4.620,1	4.568,6	4.113,3	4.067,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-106,5	-412,3	201,4	30,1
Überdeckung	(Mio. €)	904,8	685,8	1.170,8	912,7	1.030,9	800,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27,4	19,2	33,9	25,0	33,4	24,5

* 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**

3. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe		Q3/2013		Q3/2012	
		Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:					
≤ 1 Jahr		177,8	1.210,0	58,6	1.220,9
> 1 Jahr und ≤ 5 Jahre		1.793,1	1.359,4	1.870,6	1.188,2
davon	> 1 Jahr und ≤ 2 Jahre	264,0	329,5	178,7	336,9
	> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	460,2	258,7	275,5	288,5
	> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	843,3	354,4	558,4	253,8
	> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	225,7	416,8	858,0	308,9
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre		700,0	585,4	798,2	765,4
> 10 Jahre		627,8	1.048,8	842,3	1.081,0

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

Weitere Deckungswerte *)

3. Quartal

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

	Q3/2013 Mio. €	Q3/2012 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**

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. €
Gesamtsumme - alle Staaten	30.09.2013	4.203,6	538,6	589,7	754,3	2.321,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	4.255,4	433,8	783,4	789,7	2.248,5	-	-	-	-	-
Deutschland	30.09.2013	1.241,2	18,3	16,2	-	1.206,8	-	-	-	-	-
	30.09.2012	1.124,0	20,0	66,2	-	1.037,8	-	-	-	-	-
Belgien	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Australien	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	26,4	-	-	-	26,4	-	-	-	-	-
Dänemark	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Estland	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	30.09.2013	161,3	-	-	-	161,3	-	-	-	-	-
	30.09.2012	165,2	-	-	-	165,2	-	-	-	-	-
Griechenland	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Irland	30.09.2013	81,1	-	-	-	81,1	-	-	-	-	-
	30.09.2012	97,3	-	-	-	97,3	-	-	-	-	-

		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. €
Italien	30.09.2013	157,4	102,7	40,2	-	14,5	-	-	-	-	-
	30.09.2012	206,5	103,1	91,3	-	12,1	-	-	-	-	-
Lettland	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Litauen	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	30.09.2013	324,3	-	-	-	324,3	-	-	-	-	-
	30.09.2012	326,7	-	-	-	326,7	-	-	-	-	-
Neuseeland	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	24,1	-	-	-	24,1	-	-	-	-	-
Niederlande	30.09.2013	184,2	71,0	-	-	113,2	-	-	-	-	-
	30.09.2012	178,1	71,0	-	-	107,1	-	-	-	-	-
Österreich	30.09.2013	98,1	43,1	45,0	-	10,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	97,3	47,3	45,0	-	5,0	-	-	-	-	-
Polen	30.09.2013	173,0	173,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	150,1	150,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	30.09.2013	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Rumänien	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	30.09.2013	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
Slowakei	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	30.09.2013	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	120,0	-	-	-	120,0	-	-	-	-	-
Tschechien	30.09.2013	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	30.09.2013	65,0	40,0	-	-	25,0	-	-	-	-	-
	30.09.2012	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
Zypern	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Island	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

		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
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Liechtenstein	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Norwegen	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	109,8	-	-	-	109,8	-	-	-	-	-
Schweiz	30.09.2013	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
	30.09.2012	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
Japan	30.09.2013	18,2	-	-	18,2	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	24,9	-	-	24,9	-	-	-	-	-	-
Kanada	30.09.2013	227,3	-	177,3	50,0	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	235,2	-	185,2	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	30.09.2013	1.007,7	10,5	311,0	686,1	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	1.122,8	12,4	395,7	714,8	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	30.09.2013	89,4	-	-	-	89,4	-	-	-	-	-
	30.09.2012	91,4	-	-	-	91,4	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	30.09.2013	50,0	50,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	30.09.2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-