

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2012

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2012	Q4/2011	Q2/2012	Q4/2011	Q2/2012	Q4/2011
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.675,8	3.635,9	3.697,1	3.609,6	3.331,5	3.253,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-462,0	-402,5	-102,4	-69,7
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.483,3	4.394,0	4.750,7	4.611,8	4.266,5	4.162,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-477,4	-401,1	26,4	94,1
Überdeckung	(Mio. €)	807,6	758,1	1.053,6	1.002,2	934,9	909,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		22,0	20,9	28,5	27,8	28,1	27,9

* 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**

2. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe		Q2/2012		Q4/2011	
Restlaufzeit:		Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 1 Jahr		175,8	1.327,5	275,2	1.451,5
> 1 Jahr und ≤ 5 Jahre		1.894,6	1.191,1	1.452,9	1.036,3
davon	> 1 Jahr und ≤ 2 Jahre	187,1	384,8	54,0	230,2
	> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	279,8	207,7	166,8	260,2
	> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	547,8	255,6	780,7	269,9
	> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	879,9	343,0	451,5	275,9
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre		660,1	823,8	1.073,8	707,6
> 10 Jahre		945,3	1.141,0	833,9	1.198,6

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

Weitere Deckungswerte *)

2. Quartal

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

	Q2/2012 Mio. €	Q4/2011 Mio. €
Deckungsaktiva	305,0	430,0

* 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	30.06.2012	4.483,3	444,7	810,1	848,2	2.380,4	-	-	-	-	-
	31.12.2011	4.394,0	425,0	800,9	821,2	2.347,0	-	-	-	-	-
Deutschland	30.06.2012	1.183,8	19,7	76,3	-	1.087,7	-	-	-	-	-
	31.12.2011	1.360,3	69,2	76,7	-	1.214,3	-	-	-	-	-
Belgien	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Australien	30.06.2012	25,8	-	-	-	25,8	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Dänemark	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Estland	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	30.06.2012	164,6	-	-	-	164,6	-	-	-	-	-
	31.12.2011	176,3	-	-	-	176,3	-	-	-	-	-
Griechenland	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Irland	30.06.2012	97,1	-	-	-	97,1	-	-	-	-	-
	31.12.2011	96,5	-	-	-	96,5	-	-	-	-	-
Italien	30.06.2012	197,9	103,3	92,3	-	2,3	-	-	-	-	-
	31.12.2011	91,9	-	91,9	-	-	-	-	-	-	-
Lettland	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

		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. €
Litauen	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	30.06.2012	330,8	-	-	-	330,8	-	-	-	-	-
	31.12.2011	176,6	-	-	-	176,6	-	-	-	-	-
Neuseeland	30.06.2012	77,6	-	-	-	77,6	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	30.06.2012	177,6	71,0	-	-	106,6	-	-	-	-	-
	31.12.2011	176,6	71,0	-	-	105,6	-	-	-	-	-
Österreich	30.06.2012	96,6	46,6	45,0	-	5,0	-	-	-	-	-
	31.12.2011	153,2	95,4	45,0	-	12,8	-	-	-	-	-
Polen	30.06.2012	133,8	108,9	-	-	24,9	-	-	-	-	-
	31.12.2011	99,2	73,9	-	-	25,3	-	-	-	-	-
Portugal	30.06.2012	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.12.2011	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Rumänien	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	30.06.2012	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.12.2011	100,0	50,0	-	-	50,0	-	-	-	-	-
Slowakei	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Slowenien	30.06.2012	52,0	52,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	52,0	52,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	30.06.2012	120,0	-	-	-	120,0	-	-	-	-	-
	31.12.2011	195,0	-	-	-	195,0	-	-	-	-	-
Tschechien	30.06.2012	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	31.12.2011	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Ungarn	30.06.2012	35,0	-	-	-	35,0	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Zypern	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Island	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Liechtenstein	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Norwegen	30.06.2012	109,9	-	-	-	109,9	-	-	-	-	-
	31.12.2011	119,9	-	-	-	119,9	-	-	-	-	-
Schweiz	30.06.2012	25,5	-	-	-	25,5	-	-	-	-	-
	31.12.2011	58,4	-	-	-	58,4	-	-	-	-	-
Japan	30.06.2012	25,0	-	-	25,0	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	25,4	-	-	25,4	-	-	-	-	-	-
Kanada	30.06.2012	239,8	-	189,8	50,0	-	-	-	-	-	-

		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. €
	31.12.2011	234,6	-	184,6	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	30.06.2012	1.193,0	13,2	406,6	773,2	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	1.161,8	13,5	402,6	745,7	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	30.06.2012	92,7	-	-	-	92,7	-	-	-	-	-
	31.12.2011	91,4	-	-	-	91,4	-	-	-	-	-
EU-Institutionen	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Übrige Staaten/Institutionen	30.06.2012	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2011	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-