

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2016

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1/2016	Q1/2015	Q1/2016	Q1/2015	Q1/2016	Q1/2015
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.239,1	3.381,9	3.501,1	3.567,8	2.932,4	3.145,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-177,5	-346,7	75,1	-51,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.046,3	4.342,4	4.419,2	4.732,5	3.854,1	4.255,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-116,0	-299,9	72,3	114,2
Überdeckung	(Mio. €)	807,2	960,5	918,1	1.164,6	921,7	1.109,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,9	28,4	26,2	32,6	31,4	35,3

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

Anmerkung:

Die NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank weist daraufhin, dass die Nominalwerte der Deckungsmassen die sichernde Überdeckung [§4 (1) PfandBG] und Liquiditätsreserve [§4 (1a) PfandBG] beinhalten.

NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank

7, rue Lou Hemmer

L - 1748 Luxembourg-Findel

Telefon: +352 452211-1

Telefax: +352 452211-411

www.nordlb.lu

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

**Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques)
und der dafür verwendeten Deckungsmassen
Q1/2016**

Öffentliche Pfandbriefe	Q1/2016		Q1/2015	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	8,0	1.220,3	13,5	1.374,9
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	214,0	31,2	486,0	100,1
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	346,2	149,8	8,0	147,4
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	35,0	297,4	418,9	96,4
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	576,8	271,4	458,9	452,8
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	641,8	410,7	131,3	238,5
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	15,0	183,7	631,8	263,4
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	596,6	679,9	485,7	734,7
> 10 Jahre	805,7	801,9	747,7	934,1

NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank

7, rue Lou Hemmer
L - 1748 Luxembourg-Findel
Telefon: +352 452211-1
Telefax: +352 452211-411
www.nordlb.lu

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2016

		Q1/2016	Q1/2015
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.239,1	3.381,9
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	89,7%	85,3%
Deckungsmasse		4.046,3	4.342,4
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzung nach Art. 12-5 Abs.4 des Gesetzes vom 05/04/1993 über den Finanzsektor (Luxemburg) überschreiten	(Mio. €)	-	-
davon Anteil festverzinsliche Deckungswerte	(in %)	73,4%	76,0%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-6,9	-0,2
CHF	(Mio. €)	86,2	-50,4
EUR	(Mio. €)	742,8	976,6
GBP	(Mio. €)	-11,5	-2,6
JPY	(Mio. €)	13,3	-28,6
NOK	(Mio. €)	-3,7	5,2
USD	(Mio. €)	101,5	209,9

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

Die NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank weist daraufhin, dass die Nominalwerte der Deckungsmassen die sichernde Überdeckung [§4 (1) PfandBG] und Liquiditätsreserve [§4 (1a) PfandBG] beinhalten.

NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank

7, rue Lou Hemmer
L - 1748 Luxembourg-Findel
Telefon: +352 452211-1
Telefax: +352 452211-411
www.nordlb.lu

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

Weitere Deckungswerte *)

Q1/2016

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr. 2		
	Q1/2016 Mio. €	Q1/2015 Mio. €
Deckungsaktiva	105,0	145,0
davon		
Deutschland	0,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Frankreich	0,0	100,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	100,0
Norwegen	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-
Spanien	0,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	20,0
Finland	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-
Dänemark	40,0	
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	40,0	
Schweden	25,0	
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	25,0	

* 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)

NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank

7, rue Lou Hemmer
L - 1748 Luxembourg-Findel
Telefon: +352 452211-1
Telefax: +352 452211-411
www.nordlb.lu

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 Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.03.2016	4.046,3	341,5	1185,9	519,5	1999,5	-	-	-	-	-
	31.03.2015	4.342,4	406,5	949,0	862,2	2.124,7	-	-	-	-	-
Deutschland	31.03.2016	1.710,7	17,2	498,6	23,0	1.171,9	-	-	-	-	-
	31.03.2015	1.731,0	26,0	398,0	24,2	1.282,8	-	-	-	-	-
Dänemark	31.03.2016	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	31.03.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	31.03.2016	39,0	-	-	-	39,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	161,8	-	-	-	161,8	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.03.2016	299,4	-	-	-	299,4	-	-	-	-	-
	31.03.2015	71,9	-	-	-	71,9	-	-	-	-	-
Irland	31.03.2016	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	81,8	-	-	-	81,8	-	-	-	-	-
Italien	31.03.2016	106,6	106,6	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2015	136,1	108,2	27,9	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.03.2016	25,8	-	-	-	25,8	-	-	-	-	-
	31.03.2015	62,5	-	-	-	62,5	-	-	-	-	-
Niederlande	31.03.2016	104,6	-	-	-	104,6	-	-	-	-	-
	31.03.2015	139,4	-	-	-	139,4	-	-	-	-	-
Österreich	31.03.2016	87,7	40,7	-	-	47,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	95,7	43,7	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-

		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	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Polen	31.03.2016	138,6	138,6	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2015	188,0	188,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	31.03.2016	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	31.03.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2015	70,0	-	-	-	70,0	-	-	-	-	-
Tschechien	31.03.2016	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Norwegen	31.03.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	31.03.2016	16,8	-	-	16,8	-	-	-	-	-	-
	31.03.2015	17,4	-	-	17,4	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.03.2016	246,6	-	196,6	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.03.2015	258,0	-	208,0	-	50,0	-	-	-	-	-
USA	31.03.2016	978,8	8,4	490,7	479,7	-	-	-	-	-	-
	31.03.2015	1.109,3	10,6	278,1	820,5	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.03.2016	52,7	-	-	-	52,7	-	-	-	-	-
	31.03.2015	100,8	-	-	-	100,8	-	-	-	-	-
Supranational	31.03.2016	89,1	-	-	-	89,1	-	-	-	-	-
	31.03.2015	88,8	-	-	-	88,8	-	-	-	-	-

NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank

7, rue Lou Hemmer
L - 1748 Luxembourg-Findel
Telefon: +352 452211-1
Telefax: +352 452211-411
www.nordlb.lu