

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2015

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2015	Q4/2014	Q4/2015	Q4/2014	Q4/2015	Q4/2014
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.197,2	3.193,5	3.366,9	3.424,2	3.219,2	3.026,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-160,1	-270,5	-68,0	-6,9
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.017,1	4.048,0	4.316,7	4.445,1	4.221,1	4.004,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-137,0	-185,4	-59,3	143,2
Überdeckung	(Mio. €)	819,9	854,5	949,8	1.020,9	1.001,9	977,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,6	26,8	28,2	29,8	31,1	32,3

* 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
Q4/2015**

Öffentliche Pfandbriefe	Q4/2015		Q4/2014	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	6,0	1.070,8	80,4	1.310,3
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	195,0	112,8	425,5	161,7
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	370,3	57,6	6,0	122,0
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	16,0	132,9	442,0	207,5
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	610,7	508,9	494,5	356,8
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	131,8	313,8	164,1	313,6
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	525,0	291,0	221,8	153,2
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	601,3	710,2	613,7	507,1
> 10 Jahre	741,1	819,0	745,5	915,8

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

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2015

		Q4/2015	Q4/2014
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.197,2	3.193,5
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	89,6%	78,8%
Deckungsmasse		4.017,1	4.048,0
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 %)	76,2%	75,4%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-7,1	-0,2
CHF	(Mio. €)	88,1	-43,2
EUR	(Mio. €)	636,6	771,0
GBP	(Mio. €)	35,1	6,0
JPY	(Mio. €)	17,0	3,6
NOK	(Mio. €)	7,9	5,0
USD	(Mio. €)	224,3	235,2

* 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 *)

Q4/2015

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

	Q4/2015 Mio. €	Q4/2014 Mio. €
Deckungsaktiva	80,0	145,0
davon		
Deutschland	0,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	0,0
Frankreich	0,0	100,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	100,0
Norwegen	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	0,0
Spanien	0,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	20,0
Finland	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	0,0
Dänemark	40,0	
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	40,0	

* 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**
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	31.12.2015	4.017,1	340,3	959,7	811,5	1.905,6	-	-	-	-	-
	31.12.2014	4.048,0	442,6	628,8	745,3	2.231,3	-	-	-	-	-
Deutschland	31.12.2015	1.732,5	16,8	498,6	23,3	1.193,8	-	-	-	-	-
	31.12.2014	1.419,8	47,5	130,6	-	1.241,7	-	-	-	-	-
Dänemark	31.12.2015	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	31.12.2015	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	31.12.2015	38,0	-	-	-	38,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	160,8	-	-	-	160,8	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.12.2015	169,8	-	-	-	169,8	-	-	-	-	-
	31.12.2014	47,0	-	-	-	47,0	-	-	-	-	-
Irland	31.12.2015	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	76,1	-	-	-	76,1	-	-	-	-	-
Italien	31.12.2015	106,9	106,9	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2014	128,0	103,3	24,7	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.12.2015	69,8	-	-	-	69,8	-	-	-	-	-
	31.12.2014	271,0	-	-	-	271,0	-	-	-	-	-
Niederlande	31.12.2015	99,0	-	-	-	99,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	136,0	-	-	-	136,0	-	-	-	-	-
Österreich	31.12.2015	86,7	39,7	-	-	47,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	94,7	42,7	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	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Polen	31.12.2015	137,6	137,6	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2014	169,1	169,1	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	31.12.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2014	95,0	-	-	-	95,0	-	-	-	-	-
Tschechien	31.12.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2014	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Norwegen	31.12.2015	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	31.12.2015	16,4	-	-	16,4	-	-	-	-	-	-
	31.12.2014	15,5	-	-	15,5	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.12.2015	255,6	-	205,6	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.12.2014	234,3	-	184,3	-	50,0	-	-	-	-	-
USA	31.12.2015	1.036,6	9,3	255,5	771,8	-	-	-	-	-	-
	31.12.2014	991,9	-	252,2	729,8	9,9	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.12.2015	55,1	-	-	-	55,1	-	-	-	-	-
	31.12.2014	94,4	-	-	-	94,4	-	-	-	-	-
Supranational	31.12.2015	88,2	-	-	-	88,2	-	-	-	-	-
	31.12.2014	84,4	50,0	-	-	34,4	-	-	-	-	-

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