

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2015

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2015	Q2/2014	Q2/2015	Q2/2014	Q2/2015	Q2/2014
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.312,9	3.073,3	3.507,7	3.230,1	2.976,4	2.849,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-190,2	-238,5	-51,0	-32,4
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.274,9	3.913,8	4.593,5	4.285,8	3.934,9	3.832,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-111,1	-125,5	114,2	155,6
Überdeckung	(Mio. €)	962,0	840,5	1.085,8	1.055,7	958,5	982,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		29,0	27,3	31,0	32,7	32,2	34,5

* 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**

2. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe	Q2/2015		Q2/2014	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	466,8	1.261,4	34,5	1.123,4
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	6,0	244,7	227,0	218,0
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	292,0	166,6	436,4	140,6
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	474,9	130,6	6,0	113,8
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	146,0	478,2	844,6	322,3
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	70,7	214,6	146,0	425,7
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	631,8	234,3	73,5	163,9
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	476,8	696,5	608,2	480,8
> 10 Jahre	748,0	848,1	697,1	925,2

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 | Q2/2015

		Q2/2015	Q2/2014
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.312,9	3.073,3
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	87,7%	75,8%
Deckungsmasse		4.274,9	3.913,8
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 %)	73,9%	75,8%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-8,3	
CHF	(Mio. €)	-121,6	
EUR	(Mio. €)	258,7	
GBP	(Mio. €)	10,5	
JPY	(Mio. €)	-31,7	
NOK	(Mio. €)	-2,5	
USD	(Mio. €)	-128,7	

* 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. 4 und 5 PfandBG (Deutschland)

Weitere Deckungswerte *)

2. Quartal

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

	Q2/2015 Mio. €	Q2/2014 Mio. €
Deckungsaktiva	95,0	125,0
davon		
Deutschland	25,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Frankreich	50,0	100,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	50,0	100,0
Schweden	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Spanien	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-

* 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**
2. Quartal

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	30.06.2015	4.274,9	397,0	1.025,4	818,9	2.033,6	-	-	-	-	-
	30.06.2014	3.913,8	421,7	573,6	736,5	2.182,0	-	-	-	-	-
Deutschland	30.06.2015	1.829,5	18,3	548,0	23,9	1.239,3	-	-	-	-	-
	30.06.2014	1.297,1	17,4	75,0	-	1.204,7	-	-	-	-	-
Frankreich	30.06.2015	111,5	-	-	-	111,5	-	-	-	-	-
	30.06.2014	159,3	-	-	-	159,3	-	-	-	-	-
Großbritannien	30.06.2015	102,3	-	-	-	102,3	-	-	-	-	-
	30.06.2014	31,8	-	-	-	31,8	-	-	-	-	-
Irland	30.06.2015	78,9	-	-	-	78,9	-	-	-	-	-
	30.06.2014	78,0	-	-	-	78,0	-	-	-	-	-
Italien	30.06.2015	135,2	108,4	26,8	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	139,3	102,9	22,0	-	14,5	-	-	-	-	-
Luxemburg	30.06.2015	94,7	-	-	-	94,7	-	-	-	-	-
	30.06.2014	293,8	-	-	-	293,8	-	-	-	-	-
Niederlande	30.06.2015	141,7	-	-	-	141,7	-	-	-	-	-
	30.06.2014	126,3	-	-	-	126,3	-	-	-	-	-
Österreich	30.06.2015	90,3	43,3	37,0	-	10,0	-	-	-	-	-
	30.06.2014	93,1	41,1	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Polen	30.06.2015	137,0	137,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	170,7	170,7	-	-	-	-	-	-	-	-
Portugal	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Spanien	30.06.2015	70,0	-	-	-	70,0	-	-	-	-	-
	30.06.2014	95,0	-	-	-	95,0	-	-	-	-	-
Tschechien	30.06.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	40,0	30,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-
Schweiz	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
Japan	30.06.2015	16,1	-	-	16,1	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	16,6	-	-	16,6	-	-	-	-	-	-
Kanada	30.06.2015	250,0	-	200,0	-	50,0	-	-	-	-	-
	30.06.2014	225,8	-	175,8	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	30.06.2015	1.002,5	9,9	213,6	779,0	-	-	-	-	-	-
	30.06.2014	943,2	9,5	263,8	669,9	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	30.06.2015	98,6	-	-	-	98,6	-	-	-	-	-
	30.06.2014	88,9	-	-	-	88,9	-	-	-	-	-
Supranational	30.06.2015	86,5	50,0	-	-	36,5	-	-	-	-	-
	30.06.2014	86,1	50,0	-	-	36,1	-	-	-	-	-

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