

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2016

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2016	Q2/2015	Q2/2016	Q2/2015	Q2/2016	Q2/2015
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.587,3	3.312,9	3.899,0	3.507,7	3.345,7	2.976,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-179,7	-190,2	-127,9	-51,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.469,0	4.274,9	4.874,5	4.593,5	4.285,1	3.934,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-147,9	-111,1	-65,5	-114,2
Überdeckung	(Mio. €)	881,7	962,0	975,5	1.085,8	939,4	958,5
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,6	29,0	25,0	31,0	28,1	32,2

* 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.

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	Q2/2016		Q2/2015	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	45,0	1.418,8	466,8	1.261,4
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	337,9	56,8	6,0	244,7
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	16,0	78,3	292,0	166,6
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	45,0	317,8	474,9	130,6
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	567,4	282,4	146,0	478,2
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	641,8	385,4	70,7	214,6
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	68,8	225,8	631,8	234,3
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	1.059,4	924,1	476,8	696,5
> 10 Jahre	806,0	779,5	748,0	848,1

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2016

		Q2/2016	Q2/2015
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.587,3	3.312,9
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	98,1%	87,7%
Deckungsmasse		4.469,0	4.274,9
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 %)	71,3%	73,9%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-10,4	-8,3
CHF	(Mio. €)	77,8	-121,6
EUR	(Mio. €)	592,7	258,7
GBP	(Mio. €)	15,9	10,5
JPY	(Mio. €)	15,1	-31,7
NOK	(Mio. €)	-5,4	-2,5
USD	(Mio. €)	253,7	-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]

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

Weitere Deckungswerte *)

2. Quartal

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 28 Abs. 2 Nr. 2		
	Q2/2016 Mio. €	Q2/2015 Mio. €
Deckungsaktiva	135,0	95,0
davon		
Deutschland	10,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	10,0	-
Frankreich	0,0	50,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	50,0
Norwegen	20,0	0,0
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	45,0	-
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	45,0	-
Spanien	-	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-

* 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				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	30.06.2016	4.469,2	315,4	1.351,1	521,4	2.281,3	-	-	-	-	-
	30.06.2015	4.274,9	397,0	1.025,4	818,9	2.033,6	-	-	-	-	-
Deutschland	30.06.2016	2.068,3	17,7	665,6	22,7	1.362,3	-	-	-	-	-
	30.06.2015	1.829,5	18,3	548,0	23,9	1.239,3	-	-	-	-	-
Dänemark	30.06.2016	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finnland	30.06.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	30.06.2016	39,9	-	-	-	39,9	-	-	-	-	-
	30.06.2015	111,5	-	-	-	111,5	-	-	-	-	-
Großbritannien	30.06.2016	358,3	-	-	-	358,3	-	-	-	-	-
	30.06.2015	102,3	-	-	-	102,3	-	-	-	-	-
Irland	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	78,9	-	-	-	78,9	-	-	-	-	-
Italien	30.06.2016	106,8	106,8	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	135,2	108,4	26,8	-	-	-	-	-	-	-
Japan	30.06.2016	18,4	-	-	18,4	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	16,1	-	-	16,1	-	-	-	-	-	-
Kanada	30.06.2016	251,6	-	201,6	-	50,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	250,0	-	200,0	-	50,0	-	-	-	-	-
Luxemburg	30.06.2016	45,6	-	-	-	45,6	-	-	-	-	-
	30.06.2015	94,7	-	-	-	94,7	-	-	-	-	-
Niederlande	30.06.2016	155,4	-	-	-	155,4	-	-	-	-	-
	30.06.2015	141,7	-	-	-	141,7	-	-	-	-	-
Norwegen	30.06.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	30.06.2016	88,7	41,7	-	-	47,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	90,3	43,3	37,0	-	10,0	-	-	-	-	-
Polen	30.06.2016	110,9	110,9	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	137,0	137,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	30.06.2016	45,0	-	-	-	45,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	70,0	-	-	-	70,0	-	-	-	-	-
Tschechien	30.06.2016	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	30.06.2016	972,5	8,3	483,9	480,3	-	-	-	-	-	-
	30.06.2015	1.002,5	9,9	213,6	779,0	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	30.06.2016	54,0	-	-	-	54,0	-	-	-	-	-
	30.06.2015	98,6	-	-	-	98,6	-	-	-	-	-
Supranational	30.06.2016	43,8	-	-	-	43,8	-	-	-	-	-
	30.06.2015	86,5	50,0	-	-	36,5	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen (Lettres de Gage publiques) verwendete Forderungen

Darstellung der garantierten Forderungen (in allen Zahlen bereits als Teil der Deckungsmasse abgebildet)

2. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	30.06.2016	343,1	5,3	115,9	-	221,9
	30.06.2015	435,3	5,3	110,2	-	319,8
Deutschland	30.06.2016	126,7				126,7
	30.06.2015	209,6				209,6
Belgien	30.06.2016					
	30.06.2015					
Dänemark	30.06.2016					
	30.06.2015					
Finnland	30.06.2016					
	30.06.2015					
Frankreich	30.06.2016					
	30.06.2015					
Griechenland	30.06.2016					
	30.06.2015					
Großbritannien	30.06.2016					
	30.06.2015					
Irland	30.06.2016					
	30.06.2015	15,0				15,0
Italien	30.06.2016					
	30.06.2015					
Japan	30.06.2016					
	30.06.2015					
Kanada	30.06.2016	165,9		115,9		50,0
	30.06.2015	160,2		110,2		50,0
Lettland	30.06.2016					
	30.06.2015					
Litauen	30.06.2016					
	30.06.2015					
Luxemburg	30.06.2016					
	30.06.2015					
Neuseeland	30.06.2016					
	30.06.2015					
Niederlande	30.06.2016					
	30.06.2015					
Norwegen	30.06.2016					
	30.06.2015					
Österreich	30.06.2016	37,0				37,0
	30.06.2015	37,0				37,0
Polen	30.06.2016					
	30.06.2015					
Portugal	30.06.2016					
	30.06.2015					
Rumänien	30.06.2016					
	30.06.2015					
Schweden	30.06.2016					
	30.06.2015					
Slowakei	30.06.2016					
	30.06.2015					
Slowenien	30.06.2016					
	30.06.2015					
Spanien	30.06.2016					
	30.06.2015					
Tschechien	30.06.2016					
	30.06.2015					
USA	30.06.2016	13,5	5,3			8,2
	30.06.2015	13,5	5,3			8,2
Sonstige OECD-Staaten	30.06.2016					
	30.06.2015					
Supranational	30.06.2016					
	30.06.2015					

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen (Lettres de Gage publiques) verwendete Forderungen

Verteilung der Größenklassen

2. Quartal

		Deckungswerte
		Summe
2. Quartal		Mio. €
bis zu 10 Mio €	30.06.2016	392,0
	30.06.2015	364,4
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	30.06.2016	3.452,4
	30.06.2015	2.960,7
mehr als 100 Mio €	30.06.2016	624,7
	30.06.2015	949,8
Gesamt	30.06.2016	4.469,0
	30.06.2015	4.274,9