

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2016

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2016	Q4/2015	Q4/2016	Q4/2015	Q4/2016	Q4/2015
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.649,0	3.197,2	3.892,6	3.366,9	3.808,0	3.293,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-136,3	-160,1	299,9	288,2
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.523,7	4.017,1	4.847,3	4.316,7	4.494,6	3.985,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-86,2	-137,0	-32,0	6,1
Überdeckung	(Mio. €)	874,7	819,9	954,7	949,8	683,9	691,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,0	25,6	24,5	28,2	18,0	21,0

* 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
Q4/2016

Öffentliche Pfandbriefe	Q4/2016		Q4/2015	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	354,6	1.544,6	6,0	1.070,8
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	16,0	94,9	195,0	112,8
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	45,0	295,5	370,3	57,6
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	568,8	123,5	16,0	132,9
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	131,8	336,1	610,7	508,9
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	525,0	354,4	131,8	313,8
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	153,9	192,1	525,0	291,0
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	1.007,9	893,8	601,3	710,2
> 10 Jahre	846,0	688,7	741,1	819,0

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2016

		Q4/2016	Q4/2015
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.649,0	3.197,2
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	95,7%	89,6%
Deckungsmasse		4.523,7	4.017,1
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 %)	69,0%	76,2%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-8,7	-10,3
CHF	(Mio. €)	126,4	80,1
EUR	(Mio. €)	369,9	434,5
GBP	(Mio. €)	-11,3	22,4
JPY	(Mio. €)	13,0	11,8
NOK	(Mio. €)	-16,1	-2,5
USD	(Mio. €)	210,8	155,7

* 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.

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

Weitere Deckungswerte *)

Q4/2016

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

	Q4/2016 Mio. €	Q4/2015 Mio. €
Deckungsaktiva	174,2	80,0
davon		
Deutschland	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	0,0
Frankreich	14,7	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	0,0
Norwegen	27,5	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	20,0
Spanien	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	0,0
Finland	47,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	20,0
Dänemark	40,0	40,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	40,0	40,0
Schweden	45,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	45,0	0,0

* 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
Q4/2016**

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	Q4/2016	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.12.2016	4.523,7	371,6	1263,1	524,3	2364,7	-	-	-	-	-
	31.12.2015	4.017,1	340,3	959,7	811,5	1.905,6	-	-	-	-	-
Deutschland	31.12.2016	1.878,9	77,8	563,6	22,0	1.215,5	-	-	-	-	-
	31.12.2015	1.732,5	16,8	498,6	23,3	1.193,8	-	-	-	-	-
Dänemark	31.12.2016	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
	31.12.2015	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
Finnland	31.12.2016	62,0	-	-	-	62,0	-	-	-	-	-
	31.12.2015	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Frankreich	31.12.2016	64,7	-	-	-	64,7	-	-	-	-	-
	31.12.2015	38,0	-	-	-	38,0	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.12.2016	523,4	-	-	-	523,4	-	-	-	-	-
	31.12.2015	169,8	-	-	-	169,8	-	-	-	-	-
Irland	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Italien	31.12.2016	107,2	107,2	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	106,9	106,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	31.12.2016	16,6	-	-	16,6	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	16,4	-	-	16,4	-	-	-	-	-	-
Kanada	31.12.2016	262,3	-	212,3	-	50,0	-	-	-	-	-
	31.12.2015	255,6	-	205,6	-	50,0	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.12.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.12.2015	69,8	-	-	-	69,8	-	-	-	-	-
Niederlande	31.12.2016	152,1	-	-	-	152,1	-	-	-	-	-
	31.12.2015	99,0	-	-	-	99,0	-	-	-	-	-
Norwegen	31.12.2016	27,5	-	-	-	27,5	-	-	-	-	-
	31.12.2015	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	55,1	-	-	-	55,1	-	-	-	-	-
Österreich	31.12.2016	89,3	42,3	-	-	47,0	-	-	-	-	-
	31.12.2015	86,7	39,7	-	-	47,0	-	-	-	-	-
Polen	31.12.2016	106,5	106,5	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	137,6	137,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	31.12.2016	45,0	-	-	-	45,0	-	-	-	-	-
	31.12.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	70,0	-	-	-	70,0	-	-	-	-	-
Supranational	31.12.2016	77,7	-	-	-	77,7	-	-	-	-	-
	31.12.2015	84,4	50,0	-	-	34,4	-	-	-	-	-
Tschechien	31.12.2016	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	31.12.2016	980,7	7,8	487,2	485,7	-	-	-	-	-	-
	31.12.2015	1.036,6	9,3	255,5	771,8	-	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate	31.12.2016	39,8	-	-	-	39,8	-	-	-	-	-
	31.12.2015	84,4	50,0	-	-	34,4	-	-	-	-	-

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)
Q4/2016

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.12.2016	312,5	25,8	182,4	24,0	87,0
	31.12.2015	264,3	50,2	199,1	-	15,0
Deutschland	31.12.2016	96,9	77,8	55,0	24,0	-
	31.12.2015	115,8	40,8	75,0	-	-
Irland	31.12.2016	-	-	-	-	-
	31.12.2015	15,0	-	-	-	15,0
Kanada	31.12.2016	165,3	-	122,0	-	50,0
	31.12.2015	118,1	-	118,1	-	-
Österreich	31.12.2016	37,0	-	-	-	37,0
	31.12.2015	-	-	-	-	-
USA	31.12.2016	13,3	7,7	5,6	-	-
	31.12.2015	15,4	9,3	6,1	-	-

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.nordlbcbb.lu

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

4. Quartal

		Deckungswerte
		Summe
		Q4/2016
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	31.12.2016	358,0
	31.12.2015	367,8
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	31.12.2016	3.408,6
	31.12.2015	3.084,2
mehr als 100 Mio €	31.12.2016	757,1
	31.12.2015	600,6
Gesamt	31.12.2016	4.523,7
	31.12.2015	4.052,6

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.nordlbcbb.lu