

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2017

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1/2017	Q1/2016	Q1/2017	Q1/2016	Q1/2017	Q1/2016
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.194,8	3.239,1	4.424,5	3.501,1	4.360,9	3.451,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-131,8	-177,5	322,5	265,7
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.216,5	4.046,3	5.570,3	4.419,2	5.229,5	4.126,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-76,6	-116,0	-33,7	36,2
Überdeckung	(Mio. €)	1.021,7	807,2	1.145,8	918,1	868,6	674,7
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,4	24,9	25,9	26,2	19,9	19,5

* 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.

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

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques)
und der dafür verwendeten Deckungsmassen
Q1/2017

Öffentliche Pfandbriefe	Q1/2017		Q1/2016	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	341,0	1.633,7	8,0	1.220,3
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	35,0	296,9	214,0	31,2
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	78,3	287,9	346,2	149,8
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	500,0	125,0	35,0	297,4
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	641,8	519,1	576,8	271,4
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	15,0	209,7	641,8	410,7
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	652,1	409,1	15,0	183,7
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	1.005,5	1.100,8	596,6	679,9
> 10 Jahre	926,2	634,4	805,7	801,9

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2017

		Q1/2017	Q1/2016
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.194,8	3.239,1
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	96,9%	89,7%
Deckungsmasse		5.216,5	4.046,3
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 %)	72,9%	71,4%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-7,8	-9,9
CHF	(Mio. €)	143,8	78,3
EUR	(Mio. €)	589,0	536,2
GBP	(Mio. €)	-54,1	-28,6
JPY	(Mio. €)	13,4	13,3
NOK	(Mio. €)	-16,0	-16,3
USD	(Mio. €)	200,2	101,5

* 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.

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

Weitere Deckungswerte *)

Q1/2017

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

	Q1/2017 Mio. €	Q1/2016 Mio. €
Deckungsaktiva	267,0	105,0
davon		
Niederlande	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	0,0
Österreich	8,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	0,0	0,0
Frankreich	39,5	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
Finland	57,0	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	75,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	75,0	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)

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
Q1/2017

		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	Q1/2017	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten		31.03.2017	5.216,4	538	1.509,30	513,9	2.655,20	-	-	-	-	-
		31.03.2016	4.046,3	341,5	1.185,9	519,5	1.999,5	-	-	-	-	-
Deutschland		31.03.2017	2.171,7	132,8	821,6	21,7	1.195,6	-	-	-	-	-
		31.03.2016	1.710,7	17,2	498,6	23,0	1.171,9	-	-	-	-	-
Dänemark		31.03.2017	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
		31.03.2016	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
Finnland		31.03.2017	72,0	-	-	-	72,0	-	-	-	-	-
		31.03.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Frankreich		31.03.2017	94,1	-	-	-	94,1	-	-	-	-	-
		31.03.2016	39,0	-	-	-	39,0	-	-	-	-	-
Großbritannien		31.03.2017	570,8	-	-	-	570,8	-	-	-	-	-
		31.03.2016	299,4	-	-	-	299,4	-	-	-	-	-
Irland		31.03.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
Italien		31.03.2017	107,4	107,4	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	106,6	106,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan		31.03.2017	17,1	-	-	17,1	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	16,8	-	-	16,8	-	-	-	-	-	-
Kanada		31.03.2017	259,3	-	209,3	-	50,0	-	-	-	-	-
		31.03.2016	246,6	-	196,6	-	50,0	-	-	-	-	-
Luxemburg		31.03.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
		31.03.2016	25,8	-	-	-	25,8	-	-	-	-	-
Niederlande		31.03.2017	197,5	-	-	-	197,5	-	-	-	-	-
		31.03.2016	104,6	-	-	-	104,6	-	-	-	-	-
Norwegen		31.03.2017	27,5	-	-	-	27,5	-	-	-	-	-
		31.03.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten		31.03.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	52,7	-	-	-	52,7	-	-	-	-	-
Österreich		31.03.2017	97,1	42,1	-	-	55,0	-	-	-	-	-
		31.03.2016	87,7	40,7	-	-	47,0	-	-	-	-	-
Polen		31.03.2017	143,6	143,6	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	138,6	138,6	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden		31.03.2017	75,0	-	-	-	75,0	-	-	-	-	-
		31.03.2016	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
Supranational		31.03.2017	219,2	-	-	-	219,2	-	-	-	-	-
		31.03.2016	89,1	-	-	-	89,1	-	-	-	-	-
Tschechien		31.03.2017	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Ungarn		31.03.2017	75	75,0	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USA		31.03.2017	960,6	7,1	478,4	475,1	-	-	-	-	-	-
		31.03.2016	978,8	8,4	490,7	479,7	-	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate		31.03.2017	38,5	-	-	-	38,5	-	-	-	-	-
		31.03.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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)
Q1/2017

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.01.2017	366,7	25,0	230,7	24,0	87,0
	31.01.2016	293,5	25,7	193,8	24,0	50,0
Deutschland	31.01.2017	146,8	17,8	105,0	24,0	
	31.01.2016	116,2	17,2	75,0	24,0	
Irland	31.01.2017					
	31.01.2016					
Kanada	31.01.2017	170,3		120,3		50,0
	31.01.2016	163,0		113,0		50,0
Österreich	31.01.2017	37,0				37,0
	31.01.2016	37,0				37,0
USA	31.01.2017	12,6	7,2	5,4		
	31.01.2016	14,3	8,5	5,8		

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.nordlbcbb.lu

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

1. Quartal

		Deckungswerte
		Summe
		Q1/2017
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	31.03.2017	352,8
	31.03.2016	362,9
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	31.03.2017	3.552,0
	31.03.2016	3.088,2
mehr als 100 Mio €	31.03.2017	1.311,7
	31.03.2016	595,2
Gesamt	31.03.2017	5.216,5
	31.03.2016	4.046,3

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