

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2017

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2017	Q3/2016	Q3/2017	Q3/2016	Q3/2017	Q3/2016
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.961,9	3.586,7	4.152,9	3.878,9	4.128,9	4.050,2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-98,1	-189,8	289,0	124,7
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.968,7	4.490,3	5.302,9	4.894,8	5.053,5	4.955,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-22,2	-136,6	31,3	4,1
Überdeckung	(Mio. €)	1.006,8	903,6	1.150,0	1.015,9	924,5	905,1
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,4	25,2	27,7	26,2	22,4	22,3

* 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.

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

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques)

und der dafür verwendeten Deckungsmassen

3. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe			Q3/2017		Q3/2016	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	6,0	35,0	1.796,5	64,0	1.356,0
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	6,0	12,0	76,8	270,7	327,3	143,3
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	12,0	18,0	500,0	116,5	35,0	252,0
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	18,0	24,0	123,9	177,3	79,4	164,0
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	24,0	36,0	570,3	360,8	581,5	340,5
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	36,0	48,0	642,8	414,7	570,3	290,4
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	48,0	60,0	140,9	214,8	150,2	296,9
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	60,0	120,0	943,4	1.044,8	1.008,0	910,8
> 10 Jahre	120,0	10.000,0	928,9	572,7	770,9	736,4

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2017

		Q3/2017	Q3/2016
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.961,9	3.586,7
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	97,1%	98,1%
Deckungsmasse		4.968,7	4.490,3
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 %)	68,7%	70,1%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-6,2	-7,1
CHF	(Mio. €)	16,7	135,4
EUR	(Mio. €)	609,9	526,2
GBP	(Mio. €)	-14,9	-38,4
JPY	(Mio. €)	11,6	20,3
NOK	(Mio. €)	-8,3	-13,5
USD	(Mio. €)	315,7	282,1

* 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 *)

3. Quartal

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

	Q3/2017 Mio. €	Q3/2016 Mio. €
Deckungsaktiva	232,0	182,3
davon		
Niederlande	20,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-
Österreich	8,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	8,0	-
Frankreich	15,0	22,8
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	15,0	22,8
Norwegen	0,0	27,5
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	27,5
Finland	72,0	47,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	72,0	47,0
Dänemark	52,0	40,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	52,0	40,0
Schweden	65,0	45,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	65,0	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)

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

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Sg	Gesamtsumme - alle Staaten	29.09.2017 4.968,7	463,7	1.333,9	445,6	2.725,4	-	-	-	-	-
		30.09.2016 4.490,3	359,0	1.365,1	503,1	2.263,1	-	-	-	-	-
DE	Deutschland	29.09.2017 2.077,2	151,6	716,6	21,0	1.188,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 1.998,40	62,3	695,6	22,3	1.218,2	-	-	-	-	-
BE	Belgien	29.09.2017 20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BG	Australien	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DK	Dänemark	29.09.2017 52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
EE	Estland	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FI	Finnland	29.09.2017 92,2	-	-	-	92,2	-	-	-	-	-
		30.09.2016 20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
FR	Frankreich	29.09.2017 65,0	-	-	-	65,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 61,9	-	-	-	61,9	-	-	-	-	-
GR	Griechenland	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GB	Großbritannien	29.09.2017 710,7	-	-	-	710,7	-	-	-	-	-
		30.09.2016 435,0	-	-	-	435,0	-	-	-	-	-
IE	Irland	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
IT	Italien	29.09.2017 70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 106,8	106,8	-	-	-	-	-	-	-	-
	Japan	29.09.2017 15,1	-	-	15,1	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 18,6	-	-	18,6	-	-	-	-	-	-
LV	Lettland	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LT	Litauen	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LU	Luxemburg	29.09.2017 20,5	-	-	-	20,5	-	-	-	-	-
		30.09.2016 45,6	-	-	-	45,6	-	-	-	-	-
	Kanada	29.09.2017 203,6	-	189,6	-	14,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 250,5	-	200,5	-	50,0	-	-	-	-	-
MT	Neuseeland	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 164,9	-	-	-	164,9	-	-	-	-	-
NL	Niederlande	29.09.2017 164,4	-	-	-	164,4	-	-	-	-	-
		30.09.2016 155,4	-	-	-	155,4	-	-	-	-	-
	Norwegen	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 27,5	-	-	-	27,5	-	-	-	-	-
AT	Österreich	29.09.2017 58,9	40,9	-	-	18,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 87,8	40,8	-	-	47,0	-	-	-	-	-
PL	Polen	29.09.2017 90,7	90,7	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 111,4	111,4	-	-	-	-	-	-	-	-
PT	Portugal	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
RO	Rumänien	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SE	Schweden	29.09.2017 80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 45,0	-	-	-	45,0	-	-	-	-	-
SK	Slowakei	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SI	Slowenien	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ES	Spanien	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CZ	Tschechien	29.09.2017 41,0	30,0	-	-	11,0	-	-	-	-	-
		30.09.2016 30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
HU	Ungarn	29.09.2017 80,4	75,0	-	-	5,4	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CY	Zypern	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
IS	Island	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LI	Liechtenstein	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CH	Schweiz	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
US	USA	29.09.2017 842,9	5,6	427,8	409,6	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 938,9	7,7	469,0	462,2	-	-	-	-	-	-
US	Vereinigte Arabische Emirate	29.09.2017 97,3	-	-	-	97,3	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$c	Sonstige OECD-Staaten	29.09.2017 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		30.09.2016 -	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Si	Supranational	29.09.2017 187,1	-	-	-	187,1	-	-	-	-	-
		30.09.2016 81,0	-	-	-	81,0	-	-	-	-	-

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)
3. Quartal

		Deckungswerte						
		Summe	davon					
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		
	Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
\$g		Gesamtsumme - al	29.09.2017	363,5	157,2	168,2	-	38,1
			30.09.2016	331,7	24,7	195,7	-	111,1
DE		Deutschland	29.09.2017	230,7	151,6	55,0		24,1
			30.09.2016	116,4	17,3	75,0		24,1
IE		Irland	29.09.2017	-				
			30.09.2016					
CA		Kanada	29.09.2017	122,9		108,9		14,0
			30.09.2016	165,3		115,2		50,0
AT		Österreich	29.09.2017	-				
			30.09.2016	37,0				37,0
US		USA	29.09.2017	9,9	5,6	4,3		
			30.09.2016	13,0	7,4	5,5		

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

3. Quartal

		Deckungswerte
		Summe
		Q3/2017
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	29.09.2017	388,1
	30.09.2016	379,5
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	29.09.2017	3.823,0
	30.09.2016	3.388,7
mehr als 100 Mio €	29.09.2017	757,7
	30.09.2016	722,0
Gesamt	29.09.2017	4.968,7
	30.09.2016	4.490,3