

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2018

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2018	Q2/2017	Q2/2018	Q2/2017	Q2/2018	Q2/2017
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.401,5	3.966,8	4.601,2	4.164,7	4.471,3	4.147,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-98,3	-114,5	287,2	331,3
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.488,1	4.900,8	5.940,0	5.243,0	5.513,7	4.976,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	1,1	-41,4	196,7	121,6
Überdeckung	(Mio. €)	1.086,6	934,0	1.338,7	1.078,3	1.042,4	828,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,7	23,5	29,1	25,9	23,3	20,0

* 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

2. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe			Q2/2018		Q2/2017	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	566,2	1.853,0	22,0	1.600,0
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	-	248,7	45,0	377,6
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	131,8	246,1	565,9	120,5
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	510,0	272,7	-	162,6
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	625,1	530,2	685,6	390,7
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	524,5	373,9	67,2	361,4
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	615,1	218,9	612,1	251,6
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	485,3	1.171,9	1.063,0	1.042,7
> 10 Jahre	10,0		943,5	572,8	906,0	593,7

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2018

		Q2/2018	Q2/2017
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe		(Mio. €) 4.401,5	3.966,8
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe		(in %) 97,4%	96,7%
Deckungsmasse		5.488,1	4.900,8
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 %) 68,9%	69,3%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-4,1	-6,8
CHF	(Mio. €)	-	17,5
EUR	(Mio. €)	597,0	525,0
GBP	(Mio. €)	47,5	10,3
JPY	(Mio. €)	11,9	12,0
NOK	(Mio. €)	-9,9	-14,7
USD	(Mio. €)	399,9	285,6
CZK	(Mio. €)	0,0	-

* 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. 4 und 5 PfandBG (Deutschland)

Weitere Deckungswerte *)

2. Quartal

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

	Q2/2018 Mio. €	Q2/2017 Mio. €
Deckungsaktiva	305,8	247,0
davon		
Niederlande	20,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-
Österreich	14,8	8,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	14,8	8,0
Frankreich	0,0	25,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	25,0
Norwegen	0,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	20,0
Finland	105,0	57,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	105,0	57,0
Dänemark	52,0	52,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	52,0	52,0
Schweden	85,0	65,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	85,0	65,0
Belgien	29,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	29,0	-

* 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
2. Quartal

Staat	2. Quartal	Deckungswert					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
		Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Mio. €	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Gesamtsumme - alle Staaten	29.06.2018	5.488,1	307,0	1.143,7	918,5	3.119,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	4.900,8	432,0	1.316,2	477,4	2.675,3	-	-	-	-	-
Deutschland	29.06.2018	2.384,5	116,4	544,0	504,0	1.220,1	-	-	-	-	-
	29.06.2017	2.047,43	117,2	706,6	21,4	1.202,3	-	-	-	-	-
Belgien	29.06.2018	69,0	-	-	-	69,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
China	29.06.2018	32,7	-	-	-	32,7	-	-	-	-	-
	29.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Dänemark	29.06.2018	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
Finnland	29.06.2018	185,2	-	-	-	185,2	-	-	-	-	-
	29.06.2017	77,2	-	-	-	77,2	-	-	-	-	-
Frankreich	29.06.2018	76,0	-	-	-	76,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	68,8	-	-	-	68,8	-	-	-	-	-
Großbritannien	29.06.2018	895,8	-	-	-	895,8	-	-	-	-	-
	29.06.2017	662,8	-	-	-	662,8	-	-	-	-	-
Irland	29.06.2018	5,9	-	-	-	5,9	-	-	-	-	-
	29.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Italien	29.06.2018	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	29.06.2018	14,7	-	-	14,7	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	15,7	-	-	15,7	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	29.06.2018	15,1	-	-	-	15,1	-	-	-	-	-
	29.06.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Kanada	29.06.2018	206,0	-	192,0	-	14,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	210,1	-	196,1	-	14,0	-	-	-	-	-
Neuseeland	29.06.2018	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	29.06.2018	151,2	-	-	-	151,2	-	-	-	-	-
	29.06.2017	187,6	-	-	-	187,6	-	-	-	-	-
Norwegen	29.06.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
Österreich	29.06.2018	105,7	38,9	-	-	66,8	-	-	-	-	-
	29.06.2017	95,6	40,6	-	-	55,0	-	-	-	-	-
Polen	29.06.2018	77,3	77,3	-	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	92,9	92,9	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	29.06.2018	100,0	-	-	-	100,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	65,0	-	-	-	65,0	-	-	-	-	-
Tschechische Republik	29.06.2018	11,0	-	-	-	11,0	-	-	-	-	-
	29.06.2017	41,0	30,0	-	-	11,0	-	-	-	-	-
Ungarn	29.06.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	75,0	75,0	-	-	-	-	-	-	-	-
USA	29.06.2018	807,8	4,3	403,7	399,7	-	-	-	-	-	-
	29.06.2017	860,1	6,3	413,5	440,3	-	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate	29.06.2018	110,4	-	-	-	110,4	-	-	-	-	-
	29.06.2017	35,3	-	-	-	35,3	-	-	-	-	-
Supranational	29.06.2018	113,7	-	-	-	113,7	-	-	-	-	-
	29.06.2017	184,4	-	-	-	184,4	-	-	-	-	-

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)
 2. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - al	29/06/2018	1.036,7	120,8	185,4	487,6	242,9
	29/06/2017	370,7	123,5	172,2	24,0	51,0
Deutschland	29/06/2018	904,3	116,4	75,0	484,0	228,9
	29/06/2017	196,2	117,2	55,0	24,0	-
Kanada	29/06/2018	124,4	-	110,4	-	14,0
	29/06/2017	126,7	-	112,7	-	14,0
Österreich	29/06/2018	-	-	-	-	-
	29/06/2017	37,0	-	-	-	37,0
USA	29/06/2018	8,0	4,3	-	3,6	-
	29/06/2017	10,8	6,3	-	4,5	-

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
		Q2/2018
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	29/06/2018	356,5
	29/06/2017	365,4
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	29/06/2018	3.913,5
	29/06/2017	3.783,1
mehr als 100 Mio €	29/06/2018	1.218,1
	29/06/2017	752,3
Gesamt	29/06/2018	5.488,1
	29/06/2017	4.900,8