

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2019

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1/2019	Q1/2018	Q1/2019	Q1/2018	Q1/2019	Q1/2018
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.489,4	4.338,9	4.721,2	4.520,0	3.830,0	4.411,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-161,5	-93,1	60,7	278,9
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.638,7	5.371,0	6.338,7	5.804,7	5.116,4	5.391,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-61,4	4,9	60,1	177,4
Überdeckung	(Mio. €)	1.149,2	1.032,2	1.617,5	1.284,7	1.286,4	980,1
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,6	23,8	34,3	28,4	33,6	22,2

* 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

1. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe			Q1/2019		Q1/2018	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	81,5	2.304,8	75,3	1.835,3
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	560,3	321,6	500,0	138,9
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	10,0	150,4	81,5	307,4
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	583,5	286,0	560,3	299,9
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	555,8	523,6	542,6	384,9
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	133,9	162,3	555,7	486,2
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	1.024,0	488,0	133,7	195,2
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	466,9	916,7	977,2	1.155,4
> 10 Jahre	10,0		1.073,5	485,3	912,7	567,9

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2019

		Q1/2019	Q1/2018
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.489,4	4.338,9
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	97,5%	97,3%
Deckungsmasse		5.638,7	5.371,0
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 %)	63,7%	69,0%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-0,0	-4,5
CHF	(Mio. €)	-	-
EUR	(Mio. €)	620,8	547,4
GBP	(Mio. €)	184,8	8,4
JPY	(Mio. €)	10,1	11,7
NOK	(Mio. €)	-3,6	-9,6
USD	(Mio. €)	442,2	426,6
CZK	(Mio. €)	0,0	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 *)

1. Quartal

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

	Q1/2019 Mio. €	Q1/2018 Mio. €
Deckungsaktiva	161,0	299,0
davon		
Niederlande	20,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	20,0
Österreich	8,0	8,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	8,0	8,0
Frankreich	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Norwegen	0,0	0,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
Finland	58,0	105,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	58,0	105,0
Dänemark	10,0	52,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	10,0	52,0
Schweden	65,0	85,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	65,0	85,0
Belgien	0,0	29,0
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
1. Quartal

Staat	1. Quartal	Deckungswert					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	31.03.2019	5.638,7	220,0	907,7	955,1	3.556,0	-	-	-	-	-
	31.03.2018	5.371,0	368,9	1.155,1	873,9	2.973,1	-	-	-	-	-
Deutschland	31.03.2019	2.507,7	116,9	347,0	521,0	1.522,8	-	-	-	-	-
	31.03.2018	2.187,95	150,3	576,0	478,3	983,3	-	-	-	-	-
Belgien	31.03.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.03.2018	69,0	-	-	-	69,0	-	-	-	-	-
China	31.03.2019	68,0	-	-	-	68,0	-	-	-	-	-
	31.03.2018	31,7	-	-	-	31,7	-	-	-	-	-
Dänemark	31.03.2019	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	31.03.2018	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
Finnland	31.03.2019	143,2	-	-	-	143,2	-	-	-	-	-
	31.03.2018	185,2	-	-	-	185,2	-	-	-	-	-
Frankreich	31.03.2019	76,6	-	-	-	76,6	-	-	-	-	-
	31.03.2018	79,9	-	-	-	79,9	-	-	-	-	-
Großbritannien	31.03.2019	1.059,9	-	-	-	1.059,9	-	-	-	-	-
	31.03.2018	901,7	-	-	-	901,7	-	-	-	-	-
Irland	31.03.2019	16,9	-	-	-	16,9	-	-	-	-	-
	31.03.2018	5,9	-	-	-	5,9	-	-	-	-	-
Italien	31.03.2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	31.03.2019	14,9	-	-	14,9	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	14,9	-	-	14,9	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	31.03.2019	40,2	-	-	-	40,2	-	-	-	-	-
	31.03.2018	34,7	-	-	-	34,7	-	-	-	-	-
Kanada	31.03.2019	213,2	-	199,2	14,0	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	195,6	-	181,6	-	14,0	-	-	-	-	-
Neuseeland	31.03.2019	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	31.03.2019	167,7	-	-	-	167,7	-	-	-	-	-
	31.03.2018	193,3	-	-	-	193,3	-	-	-	-	-
Norwegen	31.03.2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	31.03.2019	100,3	40,0	-	-	60,3	-	-	-	-	-
	31.03.2018	66,3	37,7	-	-	28,5	-	-	-	-	-
Polen	31.03.2019	59,5	59,5	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	85,6	76,4	-	-	9,2	-	-	-	-	-
Schweden	31.03.2019	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
	31.03.2018	100,0	-	-	-	100,0	-	-	-	-	-
Südkorea	31.03.2019	15,9	-	-	-	15,9	-	-	-	-	-
	31.03.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Tschechische Republik	31.03.2019	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.03.2018	53,2	30,0	-	-	23,2	-	-	-	-	-
Ungarn	31.03.2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	5,0	-	-	-	5,0	-	-	-	-	-
USA	31.03.2019	766,2	3,6	357,5	405,2	-	-	-	-	-	-
	31.03.2018	831,3	4,5	397,5	380,7	48,6	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate	31.03.2019	144,4	-	-	-	144,4	-	-	-	-	-
	31.03.2018	89,7	-	-	-	89,7	-	-	-	-	-
Supranational	31.03.2019	115,2	-	-	-	115,2	-	-	-	-	-
	31.03.2018	118,1	-	-	-	118,1	-	-	-	-	-

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)
 1. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - al	31/03/2019	1.162,0	120,5	134,5	519,7	387,3
	31/03/2018	950,3	154,8	295,4	462,0	38,1
Deutschland	31/03/2019	956,4	116,9	20,0	502,0	317,5
	31/03/2018	823,3	150,3	191,0	457,9	24,1
Kanada	31/03/2019	128,5	-	114,5	14,0	-
	31/03/2018	118,4	-	104,4	-	14,0
VAE	31/03/2019	53,9	-	-	-	53,9
	31/03/2018	-	-	-	-	-
USA	31/03/2019	7,3	3,6	-	3,7	-
	31/03/2018	8,6	4,5	-	4,1	-
Südkorea	31/03/2019	15,9	-	-	-	15,9
	31/03/2018	-	-	-	-	-

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
		Q1/2019
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	31/03/2019	349,2
	31/03/2018	441,1
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	31/03/2019	4.015,9
	31/03/2018	3.921,6
mehr als 100 Mio €	31/03/2019	1.273,5
	31/03/2018	567,6
Gesamt	31/03/2019	5.638,7
	31/03/2018	4.930,3