

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2019

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2019	Q3/2018	Q3/2019	Q3/2018	Q3/2019	Q3/2018
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.433,7	4.401,5	4.746,8	4.594,2	3.952,5	4.479,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-245,4	-93,5	-277,3	312,2
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.551,2	5.488,1	6.368,9	5.935,9	5.185,2	5.507,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-77,2	10,2	-4,5	206,0
Überdeckung	(Mio. €)	1.117,5	1.086,6	1.622,0	1.341,7	1.232,8	1.028,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,2	24,7	34,2	29,2	31,2	23,0

* 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

3. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe			Q3/2019		Q3/2018	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	560,3	2.448,7	500,0	1.921,5
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	10,0	163,3	81,5	320,4
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	601,9	292,0	560,3	309,3
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	550,5	273,6	10,0	130,7
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	135,2	339,7	1.119,3	564,1
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	509,0	135,1	140,2	327,9
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	645,8	516,6	509,0	275,6
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	377,7	966,7	477,4	1.194,4
> 10 Jahre	10,0		1.043,2	415,5	1.033,0	504,1

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2019

		Q3/2019	Q3/2018
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.433,7	4.430,6
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	97,4%	97,4%
Deckungsmasse		5.551,2	5.548,0
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 %)	61,8%	68,3%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-0,0	-3,7
CHF	(Mio. €)	-	-
EUR	(Mio. €)	525,9	604,3
GBP	(Mio. €)	230,5	45,0
JPY	(Mio. €)	10,9	11,8
NOK	(Mio. €)	-4,2	-10,0
USD	(Mio. €)	469,6	381,5
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 *)

3. Quartal

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

	Q3/2019 Mio. €	Q3/2018 Mio. €
Deckungsaktiva	120,0	275,8
davon		
Niederlande	20,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	20,0
Österreich	8,0	14,8
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	8,0	14,8
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	15,0	105,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	15,0	105,0
Dänemark	12,0	22,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	12,0	22,0
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
3. Quartal

Staat	3. 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	30.09.2019	5.551,2	300,3	766,0	1.016,9	3.468,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	5.548,0	236,9	1.188,2	916,8	3.206,0	-	-	-	-	-
Deutschland	30.09.2019	2.425,8	117,6	230,0	536,2	1.542,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	2.481,5	116,9	598,0	507,1	1.259,5	-	-	-	-	-
Belgien	30.09.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	69,0	-	-	-	69,0	-	-	-	-	-
China	30.09.2019	67,2	-	-	-	67,2	-	-	-	-	-
	30.09.2018	32,1	-	-	-	32,1	-	-	-	-	-
Dänemark	30.09.2019	12,0	-	-	-	12,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	22,0	-	-	-	22,0	-	-	-	-	-
Finnland	30.09.2019	100,2	-	-	50,0	50,2	-	-	-	-	-
	30.09.2018	190,2	-	-	-	190,2	-	-	-	-	-
Frankreich	30.09.2019	49,3	-	-	-	49,3	-	-	-	-	-
	30.09.2018	76,8	-	-	-	76,8	-	-	-	-	-
Großbritannien	30.09.2019	1.102,5	-	-	-	1.102,5	-	-	-	-	-
	30.09.2018	917,8	-	-	-	917,8	-	-	-	-	-
Irland	30.09.2019	22,0	-	-	-	22,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	11,3	-	-	-	11,3	-	-	-	-	-
Italien	30.09.2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	30.09.2019	15,3	-	-	15,3	-	-	-	-	-	-
	30.09.2018	14,5	-	-	14,5	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	30.09.2019	58,5	-	-	-	58,5	-	-	-	-	-
	30.09.2018	29,2	-	-	-	29,2	-	-	-	-	-
Kanada	30.09.2019	219,5	-	205,5	14,0	-	-	-	-	-	-
	30.09.2018	207,3	-	193,3	-	14,0	-	-	-	-	-
Neuseeland	30.09.2019	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2018	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	30.09.2019	155,1	-	-	-	155,1	-	-	-	-	-
	30.09.2018	151,9	-	-	-	151,9	-	-	-	-	-
Österreich	30.09.2019	101,9	41,6	-	-	60,3	-	-	-	-	-
	30.09.2018	116,9	39,8	-	-	77,1	-	-	-	-	-
Polen	30.09.2019	62,9	62,9	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2018	76,4	76,4	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	30.09.2019	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	100,0	-	-	-	100,0	-	-	-	-	-
Südkorea	30.09.2019	42,7	-	-	-	42,7	-	-	-	-	-
	30.09.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Tschechische Republik	30.09.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.09.2018	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
USA	30.09.2019	731,0	3,2	326,5	401,3	-	-	-	-	-	-
	30.09.2018	791,9	3,9	392,9	395,2	-	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate	30.09.2019	143,6	-	-	-	143,6	-	-	-	-	-
	30.09.2018	127,0	-	-	-	127,0	-	-	-	-	-
Supranational	30.09.2019	117,5	75,0	-	-	42,5	-	-	-	-	-
	30.09.2018	113,1	-	-	-	113,1	-	-	-	-	-

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)
 3. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
Staat	3. Quartal		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - al	30/09/2019	1.328,2	195,8	138,2	584,9	409,3
	30/09/2018	1.120,2	120,7	211,1	491,0	297,2
Deutschland	30/09/2019	978,7	117,6	20,0	517,9	323,2
	30/09/2018	952,1	116,9	100,0	487,4	247,8
Finnland	30.09.2019	50,0	-	-	50,0	-
	30.09.2018	-	-	-	-	-
Kanada	30/09/2019	132,2	-	118,2	14,0	-
	30/09/2018	125,1	-	111,1	-	14,0
VAE	30/09/2019	54,4	-	-	-	54,4
	30/09/2018	35,4	-	-	-	35,4
USA	30/09/2019	6,2	3,2	-	3,0	-
	30/09/2018	7,5	3,9	-	3,6	-
Südkorea	30/09/2019	31,7	-	-	-	31,7
	30/09/2018	-	-	-	-	-
Supranational	30/09/2019	75,0	75,0	-	-	-
	30/09/2018	-	-	-	-	-

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
		Q3/2019
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	30/09/2019	335,1
	30/09/2018	348,9
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	30/09/2019	4.138,5
	30/09/2018	4.285,0
mehr als 100 Mio €	30/09/2019	1.077,7
	30/09/2018	914,1
Gesamt	30/09/2019	5.551,2
	30/09/2018	5.548,0