

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2019

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2019	Q4/2018	Q4/2019	Q4/2018	Q4/2019	Q4/2018
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4,357.6	4,057.8	4,609.4	4,256.6	3,863.5	4,102.1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-201.6	-121.2	-245.0	317.2
Deckungsmasse	(Mio. €)	5,535.4	5,428.2	6,290.9	6,186.7	5,134.3	5,431.2
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-90.2	20.5	-7.2	221.4
Überdeckung	(Mio. €)	1,177.8	1,370.4	1,681.4	1,930.1	1,270.8	1,329.2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		27.0	33.8	36.5	45.3	32.9	32.4

* 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

4. Quartal

Öffentliche Pfandbriefe			Q4/2019		Q4/2018	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0.0	0.5	510.0	2,533.4	-	2,112.0
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0.5	1.0	15.0	233.4	131.8	197.2
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1.0	1.5	629.3	311.0	510.0	276.1
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1.5	2.0	504.0	272.5	15.0	222.4
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2.0	3.0	131.5	199.6	1,209.3	563.3
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3.0	4.0	524.0	132.4	130.6	231.9
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4.0	5.0	678.0	541.0	524.0	155.5
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5.0	10.0	366.6	938.9	464.0	1,173.8
> 10 Jahre	10.0		999.2	373.2	1,073.1	496.3

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2019

		Q4/2019	Q4/2018
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.357,6	4.057,8
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	97,4%	97,2%
Deckungsmasse		5.535,4	5.428,2
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 %)	59,2%	65,1%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*			
CAD	(Mio. €)	-0,0	-2,9
CHF	(Mio. €)	-	-
EUR	(Mio. €)	580,1	985,4
GBP	(Mio. €)	266,3	37,2
JPY	(Mio. €)	10,0	12,1
NOK	(Mio. €)	-4,5	-10,0
USD	(Mio. €)	418,9	307,3
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 *)

4. Quartal

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

	Q4/2019 Mio. €	Q4/2018 Mio. €
Deckungsaktiva	120.0	234.8
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	95.0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	15.0	95.0
Dänemark	12.0	22.0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	12.0	22.0
Schweden	65.0	65.0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	65.0	65.0
Belgien	0.0	18.0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	18.0

* 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
4. Quartal

Staat	4. 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		31.12.2019	5.535,4	241,8	743,5	984,4	3.565,7	-	-	-	-	-
		31.12.2018	5,428,2	182,0	971,5	939,0	3,335,7	-	-	-	-	-
Deutschland		31.12.2019	2,387,7	62,4	235,1	520,0	1,570,2	-	-	-	-	-
		31.12.2018	2,328,0	61,3	417,0	512,1	1,337,5	-	-	-	-	-
Belgien		31.12.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
		31.12.2018	38,0	-	-	-	38,0	-	-	-	-	-
China		31.12.2019	63,7	-	-	-	63,7	-	-	-	-	-
		31.12.2018	74,9	-	-	-	74,9	-	-	-	-	-
Dänemark		31.12.2019	12,0	-	-	-	12,0	-	-	-	-	-
		31.12.2018	22,0	-	-	-	22,0	-	-	-	-	-
Finnland		31.12.2019	100,2	-	-	50,0	50,2	-	-	-	-	-
		31.12.2018	180,2	-	-	-	180,2	-	-	-	-	-
Frankreich		31.12.2019	52,7	-	-	-	52,7	-	-	-	-	-
		31.12.2018	75,3	-	-	-	75,3	-	-	-	-	-
Großbritannien		31.12.2019	1,203,9	-	-	-	1,203,9	-	-	-	-	-
		31.12.2018	991,2	-	-	-	991,2	-	-	-	-	-
Irland		31.12.2019	34,8	-	-	-	34,8	-	-	-	-	-
		31.12.2018	16,9	-	-	-	16,9	-	-	-	-	-
Japan		31.12.2019	14,4	-	-	14,4	-	-	-	-	-	-
		31.12.2018	14,7	-	-	14,7	-	-	-	-	-	-
Luxemburg		31.12.2019	55,9	-	-	-	55,9	-	-	-	-	-
		31.12.2018	28,9	-	-	-	28,9	-	-	-	-	-
Kanada		31.12.2019	213,2	-	199,2	14,0	-	-	-	-	-	-
		31.12.2018	209,5	-	195,5	14,0	-	-	-	-	-	-
Neuseeland		31.12.2019	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
		31.12.2018	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande		31.12.2019	153,8	-	-	-	153,8	-	-	-	-	-
		31.12.2018	149,9	-	-	-	149,9	-	-	-	-	-
Österreich		31.12.2019	101,2	41,1	-	-	60,1	-	-	-	-	-
		31.12.2018	105,6	38,4	-	-	67,1	-	-	-	-	-
Polen		31.12.2019	60,7	60,7	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.12.2018	78,8	78,8	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden		31.12.2019	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
		31.12.2018	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
Südkorea		31.12.2019	11,0	-	-	-	11,0	-	-	-	-	-
		31.12.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Tschechische Republik		31.12.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
		31.12.2018	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
USA		31.12.2019	693,9	2,7	305,2	386,1	-	-	-	-	-	-
		31.12.2018	756,7	3,5	355,0	398,1	-	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate		31.12.2019	136,4	-	-	-	136,4	-	-	-	-	-
		31.12.2018	144,0	-	-	-	144,0	-	-	-	-	-
Supranational		31.12.2019	116,0	75,0	-	-	41,0	-	-	-	-	-
		31.12.2018	114,7	-	-	-	114,7	-	-	-	-	-

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)
 4. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - al	31/12/2019	1.232.3	140.0	164.6	568.9	358.6
	31/12/2018	1.076.5	64.8	187.4	510.5	313.9
Deutschland	31/12/2019	919.9	62.4	50.1	502.0	305.3
	31/12/2018	889.6	61.3	75.0	492.8	260.6
Finnland	31.12.2019	50.0	-	-	50.0	-
	31.12.2018	-	-	-	-	-
Frankreich	31.12.2019	1.4	-	-	-	1.4
	31.12.2018	-	-	-	-	-
Kanada	31/12/2019	128.5	-	114.5	14.0	-
	31/12/2018	126.4	-	112.4	14.0	-
VAE	31/12/2019	51.9	-	-	-	51.9
	31/12/2018	53.3	-	-	-	53.3
USA	31/12/2019	5.5	2.7	-	2.9	-
	31/12/2018	7.2	3.5	-	3.7	-
Supranational	31.12.2019	75.0	75.0	-	-	-
	31.12.2018	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

4. Quartal

		Deckungswerte
		Summe
		Q4/2019
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	31/12/2019	332.3
	31/12/2018	348.5
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	31/12/2019	4,280.8
	31/12/2018	3,967.2
mehr als 100 Mio €	31/12/2019	922.4
	31/12/2018	1,112.5
Gesamt	31/12/2019	5,535.5
	31/12/2018	5,428.2