

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2018

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2018	Q3/2017	Q3/2018	Q3/2017	Q3/2018	Q3/2017
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.430,6	3.966,8	4.594,2	4.164,7	4.479,0	4.147,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-93,5	-114,5	312,2	331,3
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.548,0	4.900,8	5.935,9	5.243,0	5.507,9	4.976,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	10,2	-41,4	206,0	121,6
Überdeckung	(Mio. €)	1.117,4	934,0	1.341,7	1.078,3	1.028,9	828,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,2	23,5	29,2	25,9	23,0	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
Q3/2018

Öffentliche Pfandbriefe			Q3/2018		Q3/2017	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
			Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	500,0	1.921,5	35,0	1.796,5
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	81,5	320,4	76,8	270,7
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	560,3	309,3	500,0	116,5
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	10,0	130,7	123,9	177,3
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	1.119,3	564,1	570,3	360,8
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	140,2	327,9	642,8	414,7
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	509,0	275,6	140,9	214,8
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	477,4	1.194,4	943,4	1.044,8
> 10 Jahre	10,0		1.033,0	504,1	928,9	572,7

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2018

		Q3/2018	Q3/2017
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe		(Mio. €) 4.430,6	3.961,9
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe		(in %) 97,4%	97,1%
Deckungsmasse		5.548,0	4.968,7
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 %) 68,3%	68,7%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-3,7	-6,2
CHF	(Mio. €)	-	16,7
EUR	(Mio. €)	604,3	609,9
GBP	(Mio. €)	45,0	-14,9
JPY	(Mio. €)	11,8	11,6
NOK	(Mio. €)	-10,0	-8,3
USD	(Mio. €)	381,5	315,7
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 *)

Q3/2018

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

	Q3/2018 Mio. €	Q3/2017 Mio. €
Deckungsaktiva	275,8	232,0
davon		
Eruozone Niederlande	20,0	20,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	20,0
Eurozone Österreich	14,8	8,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	14,8	8,0
Eurozone Frankreich	0,0	15,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	15,0
Eurozone Finland	105,0	72,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	105,0	72,0
Nicht-Eurozone Dänemark	22,0	52,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	22,0	52,0
Nicht-Eurozone Schweden	85,0	65,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	85,0	65,0
Eurozone 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
Q3/2018

Staat	Q3/2018	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
			Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	
Gesamtsumme - alle Staaten	30.09.2018	5.548,0	236,9	1.188,2	916,8	3.206,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	4.968,7	429,4	1.333,9	445,7	2.759,7	-	-	-	-	
Deutschland	30.09.2018	2.481,5	116,9	598,0	507,1	1.259,5	-	-	-	-	
	30.09.2017	2.077,2	151,6	716,6	45,1	1.163,9	-	-	-	-	
Belgien	30.09.2018	69,0	-	-	-	69,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	
China	30.09.2018	32,1	-	-	-	32,1	-	-	-	-	
	30.09.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Dänemark	30.09.2018	22,0	-	-	-	22,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	
Finnland	30.09.2018	190,2	-	-	-	190,2	-	-	-	-	
	30.09.2017	92,2	-	-	-	92,2	-	-	-	-	
Frankreich	30.09.2018	76,8	-	-	-	76,8	-	-	-	-	
	30.09.2017	65,0	-	-	-	65,0	-	-	-	-	
Großbritannien	30.09.2018	917,8	-	-	-	917,8	-	-	-	-	
	30.09.2017	710,7	-	-	-	710,7	-	-	-	-	
Irland	30.09.2018	11,3	-	-	-	11,3	-	-	-	-	
	30.09.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Italien	30.09.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	30.09.2017	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	
Japan	30.09.2018	14,5	-	-	14,5	-	-	-	-	-	
	30.09.2017	15,1	-	-	15,1	-	-	-	-	-	
Luxemburg	30.09.2018	29,2	-	-	-	29,2	-	-	-	-	
	30.09.2017	20,5	-	-	-	20,5	-	-	-	-	
Kanada	30.09.2018	207,3	-	193,3	-	14,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	203,6	-	189,6	-	14,0	-	-	-	-	
Neuseeland	30.09.2018	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	
	30.09.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
Niederlande	30.09.2018	151,9	-	-	-	151,9	-	-	-	-	
	30.09.2017	164,4	-	-	-	164,4	-	-	-	-	
Österreich	30.09.2018	116,9	39,8	-	-	77,1	-	-	-	-	
	30.09.2017	58,9	40,9	-	-	18,0	-	-	-	-	
Polen	30.09.2018	76,4	76,4	-	-	-	-	-	-	-	
	30.09.2017	90,7	90,7	-	-	-	-	-	-	-	
Schweden	30.09.2018	100,0	-	-	-	100,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	
Tschechische Republik	30.09.2018	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	41,0	30,0	-	-	11,0	-	-	-	-	
Ungarn	30.09.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	30.09.2017	80,4	75,0	-	-	5,4	-	-	-	-	
USA	30.09.2018	791,9	3,9	392,9	395,2	-	-	-	-	-	
	30.09.2017	842,9	5,6	427,8	409,6	-	-	-	-	-	
Vereinigte Arabische Emirate	30.09.2018	127,0	-	-	-	127,0	-	-	-	-	
	30.09.2017	97,3	-	-	-	97,3	-	-	-	-	
Supranational	30.09.2018	113,1	-	-	-	113,1	-	-	-	-	
	30.09.2017	187,1	-	-	-	187,1	-	-	-	-	

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)
Q3/2018

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - al	30/09/2018	1.120,2	120,7	211,1	491,0	297,2
	30/09/2017	229,1	22,6	168,4	24,1	14,0
Deutschland	30/09/2018	952,1	116,9	100,0	487,4	247,8
	30/09/2017	230,7	151,6	55,0	24,1	
Kanada	30/09/2018	125,1	-	111,1	-	14,0
	30/09/2017	122,9		108,9		14,0
VAE	30/09/2018	35,4	-	-	-	35,4
	30/09/2017	-				-
USA	30/09/2018	7,5	3,9	-	3,6	-
	30/09/2017	9,9	5,6	4,3		

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

Q3/2018

		Deckungswerte
		Summe
		Q3/2018
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	30/09/2018	348,9
	30/09/2017	388,1
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	30/09/2018	4.285,0
	30/09/2017	3.823,0
mehr als 100 Mio €	30/09/2018	914,1
	30/09/2017	757,7
Gesamt	30/09/2018	5.548,0
	30/09/2017	4.968,7