

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2019

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2019	Q2/2018	Q2/2019	Q2/2018	Q2/2019	Q2/2018
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	4.504,8	4.401,5	4.772,7	4.601,2	3.978,6	4.471,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-214,7	-98,3	-258,6	287,2
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.611,1	5.488,1	6.411,7	5.940,0	5.238,8	5.513,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-19,2	1,1	37,6	196,7
Überdeckung	(Mio. €)	1.106,3	1.086,6	1.639,0	1.338,7	1.260,2	1.042,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,6	24,7	34,3	29,1	31,7	23,3

* 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			Q2/2019		Q2/2018	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	141,8	2.342,6	566,2	1.853,0
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	510,0	307,5	-	248,7
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	15,0	231,8	131,8	246,1
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	622,8	304,6	510,0	272,7
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	524,3	402,3	625,1	530,2
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	613,2	174,4	524,5	373,9
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	524,0	462,8	615,1	218,9
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	465,0	914,2	485,3	1.171,9
> 10 Jahre	10,0		1.088,8	470,8	943,5	572,8

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2019

		Q2/2019	Q2/2018
Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe			
	(Mio. €)	4.504,8	4.401,5
	(in %)	97,5%	97,4%
Deckungsmasse			
	(Mio. €)	5.611,1	5.488,1
	(in %)	63,0%	68,9%
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)			
CAD	(Mio. €)	-0,0	-4,1
CHF	(Mio. €)	-	-
EUR	(Mio. €)	554,4	597,0
GBP	(Mio. €)	224,3	47,5
JPY	(Mio. €)	10,2	11,9
NOK	(Mio. €)	-3,8	-9,9
USD	(Mio. €)	475,0	399,9
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 *)

2. Quartal

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

	Q2/2019 Mio. €	Q2/2018 Mio. €
Deckungsaktiva	140,0	305,8
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	25,0	105,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	25,0	105,0
Dänemark	22,0	52,0
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	22,0	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
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	28.06.2019	5.611,1	220,8	898,2	940,0	3.552,1	-	-	-	-	-
	29.06.2018	5.488,1	307,0	1.143,7	918,5	3.119,0	-	-	-	-	-
Deutschland	28.06.2019	2.500,3	117,1	347,0	514,3	1.522,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	2.384,5	116,4	544,0	504,0	1.220,1	-	-	-	-	-
Belgien	28.06.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	69,0	-	-	-	69,0	-	-	-	-	-
China	28.06.2019	65,7	-	-	-	65,7	-	-	-	-	-
	29.06.2018	32,7	-	-	-	32,7	-	-	-	-	-
Dänemark	28.06.2019	22,0	-	-	-	22,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
Finnland	28.06.2019	110,2	-	-	-	110,2	-	-	-	-	-
	29.06.2018	185,2	-	-	-	185,2	-	-	-	-	-
Frankreich	28.06.2019	48,2	-	-	-	48,2	-	-	-	-	-
	29.06.2018	76,0	-	-	-	76,0	-	-	-	-	-
Großbritannien	28.06.2019	1.076,8	-	-	-	1.076,8	-	-	-	-	-
	29.06.2018	895,8	-	-	-	895,8	-	-	-	-	-
Irland	28.06.2019	16,9	-	-	-	16,9	-	-	-	-	-
	29.06.2018	5,9	-	-	-	5,9	-	-	-	-	-
Italien	28.06.2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2018	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Japan	28.06.2019	14,7	-	-	14,7	-	-	-	-	-	-
	29.06.2018	14,7	-	-	14,7	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	28.06.2019	45,3	-	-	-	45,3	-	-	-	-	-
	29.06.2018	15,1	-	-	-	15,1	-	-	-	-	-
Kanada	28.06.2019	210,7	-	196,7	14,0	-	-	-	-	-	-
	29.06.2018	206,0	-	192,0	-	14,0	-	-	-	-	-
Neuseeland	28.06.2019	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2018	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
Niederlande	28.06.2019	167,0	-	-	-	167,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	151,2	-	-	-	151,2	-	-	-	-	-
Österreich	28.06.2019	100,6	40,3	-	-	60,3	-	-	-	-	-
	29.06.2018	105,7	38,9	-	-	66,8	-	-	-	-	-
Polen	28.06.2019	60,4	60,4	-	-	-	-	-	-	-	-
	29.06.2018	77,3	77,3	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweden	28.06.2019	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	100,0	-	-	-	100,0	-	-	-	-	-
Südkorea	28.06.2019	42,0	-	-	-	42,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Tschechische Republik	28.06.2019	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	29.06.2018	11,0	-	-	-	11,0	-	-	-	-	-
USA	28.06.2019	750,7	3,1	350,6	397,1	-	-	-	-	-	-
	29.06.2018	807,8	4,3	403,7	399,7	-	-	-	-	-	-
Vereinigte Arabische Emirate	28.06.2019	139,8	-	-	-	139,8	-	-	-	-	-
	29.06.2018	110,4	-	-	-	110,4	-	-	-	-	-
Supranational	28.06.2019	115,8	-	-	-	115,8	-	-	-	-	-
	29.06.2018	113,7	-	-	-	113,7	-	-	-	-	-

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)
 2. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - al	28/06/2019	1.175,4	120,1	133,1	512,4	409,7
	29/06/2018	1.036,7	120,8	185,4	487,6	242,9
Deutschland	28/06/2019	958,9	117,1	20,0	495,6	326,2
	29/06/2018	904,3	116,4	75,0	484,0	228,9
Kanada	28/06/2019	127,1	-	113,1	14,0	-
	29/06/2018	124,4	-	110,4	-	14,0
VAE	28/06/2019	52,4	-	-	-	52,4
	29/06/2018	-	-	-	-	-
USA	28/06/2019	5,9	3,1	-	2,9	-
	29/06/2018	8,0	4,3	-	3,6	-
Südkorea	28/06/2019	31,0	-	-	-	31,0
	29/06/2018	-	-	-	-	-

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
		Q2/2019
		Mio. €
bis zu 10 Mio €	28/06/2019	356,9
	29/06/2018	356,5
über 10 Mio € bis zu 100 Mio €	28/06/2019	4.084,8
	29/06/2018	3.913,5
mehr als 100 Mio €	28/06/2019	1.169,5
	29/06/2018	1.218,1
Gesamt	28/06/2019	5.611,1
	29/06/2018	5.488,1