

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2015**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2015	Q3/2014	Q3/2015	Q3/2014	Q3/2015	Q3/2014
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.275,1	3.248,2	3.446,5	3.454,1	3.102,7	3.079,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-193,7	-245,0	93,3	12,4
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.118,3	4.044,8	4.449,3	4.378,8	4.018,9	3.940,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-132,3	-160,2	33,0	155,7
Überdeckung	(Mio. €)	843,2	796,6	1.002,8	924,7	916,2	861,0
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,7	24,5	29,1	26,8	29,5	28,0

\* 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.

**NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank**

7, rue Lou Hemmer

L - 1748 Luxembourg-Findel

Telefon: +352 452211-1

Telefax: +352 452211-411

www.nordlb.lu

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	Q3/2015		Q3/2014	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	465,7	1.360,5	260,9	1.209,7
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	8,0	183,6	13,5	286,6
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	400,3	67,6	441,3	157,6
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	335,0	136,4	8,0	110,0
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	211,1	465,9	867,6	387,7
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	81,5	248,8	220,7	354,6
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	570,3	230,5	21,5	154,6
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	487,5	563,2	649,4	476,3
> 10 Jahre	715,8	861,8	765,4	907,8

**NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank**

7, rue Lou Hemmer

L - 1748 Luxembourg-Findel

Telefon: +352 452211-1

Telefax: +352 452211-411

www.nordlb.lu

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2015**

		Q3/2015	Q3/2014
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.275,1	3.248,2
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	87,1%	76,6%
<b>Deckungsmasse</b>		4.118,3	4.044,8
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 %)	73,8%	74,6%
<b>Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)</b>			
CAD	(Mio. €)	-10,5	-0,4
CHF	(Mio. €)	-111,6	-47,8
EUR	(Mio. €)	1.045,4	701,9
GBP	(Mio. €)	-2,3	14,5
JPY	(Mio. €)	-95,6	3,7
NOK	(Mio. €)	-3,1	5,6
USD	(Mio. €)	93,8	183,6

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.

**NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank**

7, rue Lou Hemmer

L - 1748 Luxembourg-Findel

Telefon: +352 452211-1

Telefax: +352 452211-411

www.nordlb.lu

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

	Q3/2015 Mio. €	Q3/2014 Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>75,0</b>	<b>145,0</b>
davon		
<b>Deutschland</b>	<b>0,0</b>	<b>25,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Frankreich</b>	<b>0,0</b>	<b>100,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	100,0
<b>Norwegen</b>	<b>25,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	25,0	-
<b>Spanien</b>	<b>50,0</b>	<b>20,0</b>
	50,0	20,0

**NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank**

7, rue Lou Hemmer

L - 1748 Luxembourg-Findel

Telefon: +352 452211-1

Telefax: +352 452211-411

www.nordlb.lu

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**

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	30.09.2015	4.118,3	388,6	903,0	795,4	2.031,3	-	-	-	-	-
	30.09.2014	4.044,8	425,2	600,2	775,4	2.244,0	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	30.09.2015	1.868,9	16,9	428,0	23,6	1.400,4	-	-	-	-	-
	30.09.2014	1.399,9	18,1	105,6	-	1.276,3	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	30.09.2015	53,0	-	-	-	53,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	160,8	-	-	-	160,8	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	30.09.2015	134,0	-	-	-	134,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	37,6	-	-	-	37,6	-	-	-	-	-
<b>Irland</b>	30.09.2015	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	78,0	-	-	-	78,0	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	30.09.2015	133,4	106,6	26,8	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2014	144,7	103,2	23,8	-	17,7	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	30.09.2015	62,1	-	-	-	62,1	-	-	-	-	-
	30.09.2014	287,0	-	-	-	287,0	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	30.09.2015	95,9	-	-	-	95,9	-	-	-	-	-
	30.09.2014	133,3	-	-	-	133,3	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	30.09.2015	49,9	39,9	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	94,7	42,7	37,0	-	15,0	-	-	-	-	-
<b>Polen</b>	30.09.2015	135,7	135,7	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2014	171,5	171,5	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	30.09.2015	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	95,0	-	-	-	95,0	-	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	30.09.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
	30.09.2014	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Ungarn	30.06.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2014	40,0	40,0	-	-	-	-	-	-	-	-
Norwegen	30.09.2015	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Schweiz	30.09.2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.09.2014	13,5	-	-	-	13,5	-	-	-	-	-
Japan	30.09.2015	16,3	-	-	16,3	-	-	-	-	-	-
	30.09.2014	18,2	-	-	18,2	-	-	-	-	-	-
Kanada	30.09.2015	249,8	-	199,8	-	50,0	-	-	-	-	-
	30.09.2014	240,3	-	190,3	50,0	-	-	-	-	-	-
USA	30.09.2015	1.013,3	9,4	248,5	755,4	-	-	-	-	-	-
	30.09.2014	962,1	9,8	243,5	708,7	-	-	-	-	-	-
Sonstige OECD-Staaten	30.09.2015	98,6	-	-	-	98,6	-	-	-	-	-
	30.09.2014	92,7	-	-	-	92,7	-	-	-	-	-
Supranational	30.09.2015	87,1	50,0	-	-	37,1	-	-	-	-	-
	30.09.2014	50,0	50,0	-	-	-	-	-	-	-	-

**NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank**

7, rue Lou Hemmer

L - 1748 Luxembourg-Findel

Telefon: +352 452211-1

Telefax: +352 452211-411

www.nordlb.lu