

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2016**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q3/2016	Q3/2015	Q3/2016	Q3/2015	Q3/2016	Q3/2015
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.586,7	3.275,1	3.878,9	3.446,5	3.657,2	3.102,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-189,8	-193,7	-12,6	93,3
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.490,3	4.118,3	4.894,8	4.449,3	4.743,6	4.018,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-136,6	-132,3	-60,8	33,0
Überdeckung	(Mio. €)	903,6	843,2	1.015,9	1.002,8	1.086,4	916,2
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,2	25,7	26,2	29,1	29,7	29,5

\* 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**  
**Q3/2016**

Öffentliche Pfandbriefe	Q3/2016		Q3/2015	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	64,0	1.356,0	465,7	1.360,5
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	327,3	143,3	8,0	183,6
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	35,0	252,0	400,3	67,6
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	79,4	164,0	335,0	136,4
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	581,5	340,5	211,1	465,9
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	570,3	290,4	81,5	248,8
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	150,2	296,9	570,3	230,5
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	1.008,0	910,8	487,5	563,2
> 10 Jahre	770,9	736,4	715,8	861,8

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

Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q3/2016

		Q3/2016	Q3/2015
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.586,7	3.275,1
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	98,1%	87,1%
<b>Deckungsmasse</b>		4.490,3	4.118,3
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 %)	70,1%	73,8%
<b>Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)</b>			
CAD	(Mio. €)	-7,1	-10,5
CHF	(Mio. €)	135,4	-111,6
EUR	(Mio. €)	707,6	1.045,4
GBP	(Mio. €)	-38,4	-2,3
JPY	(Mio. €)	20,3	-95,6
NOK	(Mio. €)	-13,5	-3,1
USD	(Mio. €)	282,0	93,8

\* 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 \*)**

**Q3/2016**

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

	<b>Q3/2016</b> Mio. €	<b>Q3/2015</b> Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>182,3</b>	<b>75,0</b>
davon		
<b>Deutschland</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Frankreich</b>	<b>22,8</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	22,8	-
<b>Norwegen</b>	<b>27,5</b>	<b>25,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	27,5	25,0
<b>Spanien</b>	<b>0,0</b>	<b>50,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	50,0
<b>Finland</b>	<b>47,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	47,0	-
<b>Dänemark</b>	<b>40,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	40,0	-
<b>Schweden</b>	<b>45,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	40,0	-

\* 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  
Q3/2016**

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	Q3/2016	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	30.09.2016	4.490,3	359,0	1.365,1	503,1	2.263,1	-	-	-	-	-
	30.09.2015	4.118,0	388,5	903,1	795,3	2.031,1	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	30.09.2016	1.998,4	62,3	695,6	22,3	1.218,2	-	-	-	-	-
	30.09.2015	1.868,9	16,9	428,0	23,6	1.400,4	-	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>	30.09.2016	40,0				40,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	-					-	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	30.09.2016	47,0				47,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	-					-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	30.09.2016	61,9				61,9	-	-	-	-	-
	30.09.2015	53,0				53,0	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	30.09.2016	435,0				435,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	134,0	-	-	-	134,0	-	-	-	-	-
<b>Irland</b>	30.09.2016	-					-	-	-	-	-
	30.09.2015	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	30.09.2016	106,8	106,8				-	-	-	-	-
	30.09.2015	133,4	106,6	26,8	-	-	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	30.09.2016	18,6			18,6		-	-	-	-	-
	30.09.2015	16,3	-	-	16,3	-	-	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	30.09.2016	250,5		200,5		50,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	249,8	-	199,8	-	50,0	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	30.09.2016	45,6	-	-	-	45,6	-	-	-	-	-
	30.09.2015	62,1	-	-	-	62,1	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	30.09.2016	164,9				164,9	-	-	-	-	-
	30.09.2015	95,9	-	-	-	95,9	-	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>	30.09.2016	27,5				27,5	-	-	-	-	-
	30.09.2015	25,0	-	-	-	25,0	-	-	-	-	-
<b>Sonstige OECD-Staaten</b>	30.09.2016	-					-	-	-	-	-
	30.09.2015	98,6	-	-	-	98,6	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	30.09.2016	87,8	40,8			47,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	49,9	39,9	-	-	10,0	-	-	-	-	-
<b>Polen</b>	30.09.2016	111,4	111,4				-	-	-	-	-
	30.09.2015	135,7	135,7	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	30.09.2016	45,0				45,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	-					-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	30.09.2016	-					-	-	-	-	-
	30.09.2015	50,0	-	-	-	50,0	-	-	-	-	-
<b>Supranational</b>	30.09.2016	81,0				81,0	-	-	-	-	-
	30.09.2015	87,1	50,0	-	-	37,1	-	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	30.09.2016	30,0	30,0				-	-	-	-	-
	30.09.2015	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	30.09.2016	938,9	7,7	469,0	462,2	-	-	-	-	-	-
	30.09.2015	1.013,3	9,4	248,5	755,4	-	-	-	-	-	-

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)**  
**Q3/2016**

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	3. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	30.09.2016	331,7	25,0	195,6	24,1	87,0
	30.09.2015	320,1	109,4	195,7	-	15,0
<b>Deutschland</b>	30.09.2016	116,4	17,3	75,0	24,1	
	30.09.2015	175,0	100,0	75,0		
<b>Irland</b>	30.09.2016					
	30.09.2015	15,0				15,0
<b>Kanada</b>	30.09.2016	165,3		115,3		50,0
	30.09.2015	114,8		114,8		-
<b>Österreich</b>	30.09.2016	37,0				37,0
	30.09.2015					
<b>USA</b>	30.09.2016	13,0	7,7	5,3		
	30.09.2015	15,3	9,4	5,9		

**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.nordlbcbb.lu

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
		Q3/2016
		Mio. €
<b>bis zu 10 Mio €</b>	30.09.2016	379,5
	30.09.2015	337,6
<b>über 10 Mio € bis zu 100 Mio €</b>	30.09.2016	3.388,7
	30.09.2015	2.826,4
<b>mehr als 100 Mio €</b>	30.09.2016	722,0
	30.09.2015	954,3
<b>Gesamt</b>	30.09.2016	4.490,3
	30.09.2015	4.118,3

**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.nordlbcbb.lu](http://www.nordlbcbb.lu)