

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2017**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2/2017	Q2/2016	Q2/2017	Q2/2016	Q2/2017	Q2/2016
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.966,8	3.587,3	4.164,7	3.899,0	4.147,1	3.761,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-114,5	-179,7	331,3	253,8
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.900,8	4.469,0	5.243,0	4.874,5	4.976,0	4.494,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-41,4	-147,9	121,6	12,6
Überdeckung	(Mio. €)	934,0	881,7	1.078,3	975,5	828,9	733,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		23,5	24,6	25,9	25,0	20,0	19,5

\* 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**  
**2. Quartal**

Öffentliche Pfandbriefe	Q2/2017		Q2/2016	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	22,0	1.600,0	45,0	1.418,8
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	45,0	377,6	337,9	56,8
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	565,9	120,5	16,0	78,3
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	-	162,6	45,0	317,8
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	685,6	390,7	567,4	282,4
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	67,2	361,4	641,8	385,4
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	612,1	251,6	68,8	225,8
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	1.063,0	1.042,7	1.059,4	924,1
> 10 Jahre	906,0	593,7	806,0	779,5

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q2/2017**

		Q2/2017	Q2/2016
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	3.966,8	3.587,3
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	96,7%	98,1%
<b>Deckungsmasse</b>		4.900,8	4.469,0
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 %)	69,3%	71,3%
<b>Nettoanwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung<sup>1)</sup></b>			
CAD	(Mio. €)	-6,8	-10,4
CHF	(Mio. €)	17,5	77,8
EUR	(Mio. €)	525,0	592,7
GBP	(Mio. €)	10,3	15,9
JPY	(Mio. €)	12,0	15,1
NOK	(Mio. €)	-14,7	-5,4
USD	(Mio. €)	285,6	253,7

<sup>1)</sup> 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		
	Q2/2017 Mio. €	Q2/2016 Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>247,0</b>	<b>135,0</b>
davon		
<b>Niederlande</b>	<b>20,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-
<b>Österreich</b>	<b>8,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	8,0	-
<b>Frankreich</b>	<b>25,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	25,0	-
<b>Norwegen</b>	<b>20,0</b>	<b>20,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	20,0
<b>Finland</b>	<b>57,0</b>	<b>20,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	57,0	20,0
<b>Dänemark</b>	<b>52,0</b>	<b>40,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	52,0	40,0
<b>Schweden</b>	<b>65,0</b>	<b>45,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	65,0	45,0
<b>Deutschland</b>	<b>0,0</b>	<b>10,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	10,0
<b>Spanien</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-

\* 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

		Deckungswerte					Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen				
		Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Summe	davon Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	2. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	30.06.2017	4.900,8	432,0	1.316,2	477,4	2.675,3	-	-	-	-	-
	30.06.2016	4.469,2	315,4	1.351,1	521,4	2.281,3	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	30.06.2017	2.047,4	117,2	706,6	21,4	1.202,3	-	-	-	-	-
	30.06.2016	2.069,30	17,7	665,6	22,7	1.362,3	-	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	30.06.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Australien</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>	30.06.2017	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
<b>Estland</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	30.06.2017	77,2	-	-	-	77,2	-	-	-	-	-
	30.06.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	30.06.2017	68,8	-	-	-	68,8	-	-	-	-	-
	30.06.2016	39,9	-	-	-	39,9	-	-	-	-	-
<b>Griechenland</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	30.06.2017	662,8	-	-	-	662,8	-	-	-	-	-
	30.06.2016	358,3	-	-	-	358,3	-	-	-	-	-
<b>Irland</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	30.06.2017	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	106,8	106,8	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	30.06.2017	15,7	-	-	15,7	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	18,4	-	-	18,4	-	-	-	-	-	-
<b>Lettland</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Litauen</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	30.06.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	45,6	-	-	-	45,6	-	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	30.06.2017	210,1	-	196,1	-	14,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	251,6	-	201,6	-	50,0	-	-	-	-	-
<b>Neuseeland</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	30.06.2017	187,6	-	-	-	187,6	-	-	-	-	-
	30.06.2016	155,4	-	-	-	155,4	-	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>	30.06.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	30.06.2017	95,6	40,6	-	-	55,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	88,7	41,7	-	-	47,0	-	-	-	-	-
<b>Polen</b>	30.06.2017	92,9	92,9	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	110,9	110,9	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Portugal</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Rumänien</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	30.06.2017	65,0	-	-	-	65,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	45,0	-	-	-	45,0	-	-	-	-	-
<b>Slowakei</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Slowenien</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	30.06.2017	41,0	30,0	-	-	11,0	-	-	-	-	-
	30.06.2016	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>	30.06.2017	75,0	75,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zypern</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Island</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Liechtenstein</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	30.06.2017	860,1	6,3	413,5	440,3	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	972,5	8,3	463,9	480,3	-	-	-	-	-	-
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>	30.06.2017	35,3	-	-	-	35,3	-	-	-	-	-
	30.06.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Sonstige OECD-Staaten</b>	30.06.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	30.06.2016	54,0	-	-	-	54,0	-	-	-	-	-
<b>Supranational</b>	30.06.2017	184,4	-	-	-	184,4	-	-	-	-	-
	30.06.2016	43,8	-	-	-	43,8	-	-	-	-	-

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. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	30.06.2017	370,7	123,5	172,2	24,0	51,0
	30.06.2016	358,1	70,9	176,2	24,0	87,0
<b>Deutschland</b>	30.06.2017	196,2	117,2	55,0	24,0	
	30.06.2016	141,7	62,7	55,0	24,0	
<b>Kanada</b>	30.06.2017	126,7		112,7		14,0
	30.06.2016	165,9		115,9		50,0
<b>Österreich</b>	30.06.2017	37,0				37,0
	30.06.2016	37,0				37,0
<b>USA</b>	30.06.2017	10,8	6,3	4,5		
	30.06.2016	13,5	8,2	5,3		

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
		Q2/2017
		Mio. €
<b>bis zu 10 Mio €</b>	30.06.2017	365,4
	30.06.2016	392,0
<b>über 10 Mio € bis zu 100 Mio €</b>	30.06.2017	3.783,1
	30.06.2016	3.452,4
<b>mehr als 100 Mio €</b>	30.06.2017	752,3
	30.06.2016	624,7
<b>Gesamt</b>	30.06.2017	4.900,8
	30.06.2016	4.469,0