

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2017**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2017	Q4/2016	Q4/2017	Q4/2016	Q4/2017	Q4/2016
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	3.971,9	3.649,0	4.164,7	3.892,6	4.139,7	3.808,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-100,9	-136,3	282,0	299,9
Deckungsmasse	(Mio. €)	4.930,4	4.523,7	5.265,3	4.847,3	5.007,5	4.494,6
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-7,3	-86,2	168,4	-32,0
Überdeckung	(Mio. €)	958,4	874,7	1.100,5	954,7	867,8	683,9
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		24,1	24,0	26,4	24,5	21,0	18,0

\* 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**

**4. Quartal**

Öffentliche Pfandbriefe	Q4/2017		Q4/2016	
Restlaufzeit:	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	45,0	2.097,2	354,6	1.544,6
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	564,4	124,6	16,0	94,9
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	-	153,9	45,0	295,5
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	173,5	176,3	568,8	123,5
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	525,0	360,2	131,8	336,1
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	638,2	445,3	525,0	354,4
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	131,8	134,8	153,9	192,1
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	981,1	862,9	1.007,9	893,8
> 10 Jahre	913,0	575,1	846,0	688,7

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2017**

		Q4/2017	Q4/2016
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>			
	(Mio. €)	3.971,9	3.649,0
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe	(in %)	97,1%	95,7%
<b>Deckungsmasse</b>			
		4.930,4	4.523,7
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 %)	61,0%	69,0%
<b>Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)</b>			
	CAD (Mio. €)	-5,1	-8,7
	CHF (Mio. €)	-	126,4
	EUR (Mio. €)	549,6	369,9
	GBP (Mio. €)	17,1	-11,3
	JPY (Mio. €)	11,2	13,0
	NOK (Mio. €)	-9,1	-16,1
	USD (Mio. €)	304,1	210,8

\* 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 \*)**

**4. Quartal**

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

	Q4/2017 Mio. €	Q4/2016 Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>217,0</b>	<b>174,2</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>0,0</b>	<b>14,7</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	14,7
<b>Norwegen</b>	<b>0,0</b>	<b>27,5</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	27,5
<b>Finland</b>	<b>72,0</b>	<b>47,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	72,0	47,0
<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	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

Staat	4. 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
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>	29.12.2017	4.930,4	426,0	1.245,0	434,7	2.824,7	-	-	-	-	-
	31.12.2016	4.523,7	371,6	1.263,1	524,3	2.364,7	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	29.12.2017	1.973,9	151,2	676,6	20,7	1.125,4	-	-	-	-	-
	31.12.2016	1.878,90	77,8	563,6	22,0	1.215,5	-	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	29.12.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Australien</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>China</b>	29.12.2017	33,4	-	-	-	33,4	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>	29.12.2017	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	29.12.2017	102,2	-	-	-	102,2	-	-	-	-	-
	31.12.2016	62,0	-	-	-	62,0	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	29.12.2017	48,9	-	-	-	48,9	-	-	-	-	-
	31.12.2016	64,7	-	-	-	64,7	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	29.12.2017	841,4	-	-	-	841,4	-	-	-	-	-
	31.12.2016	523,4	-	-	-	523,4	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	29.12.2017	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	107,2	107,2	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	29.12.2017	14,4	-	-	14,4	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	16,6	-	-	16,6	-	-	-	-	-	-
<b>Lettland</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Litauen</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	29.12.2017	35,5	-	-	-	35,5	-	-	-	-	-
	31.12.2016	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	29.12.2017	200,6	-	186,6	-	14,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	262,3	-	212,3	-	50,0	-	-	-	-	-
<b>Neuseeland</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	164,9	-	-	-	164,9	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	29.12.2017	148,5	-	-	-	148,5	-	-	-	-	-
	31.12.2016	152,1	-	-	-	152,1	-	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	27,5	-	-	-	27,5	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	29.12.2017	62,0	39,9	-	-	22,1	-	-	-	-	-
	31.12.2016	89,3	42,3	-	-	47,0	-	-	-	-	-
<b>Polen</b>	29.12.2017	64,8	54,8	-	-	10,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	106,5	106,5	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Portugal</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Rumänien</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	29.12.2017	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	45,0	-	-	-	45,0	-	-	-	-	-
<b>Slowakei</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Slowenien</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Spanien</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Tschechien</b>	29.12.2017	48,0	30,0	-	-	18,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>	29.12.2017	80,2	75,0	-	-	5,2	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zypern</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Island</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Liechtenstein</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweiz</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	29.12.2017	813,6	5,1	381,8	399,6	27,1	-	-	-	-	-
	31.12.2016	980,7	7,8	487,2	485,7	-	-	-	-	-	-
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>	29.12.2017	94,0	-	-	-	94,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	39,8	-	-	-	39,8	-	-	-	-	-
<b>Sonstige OECD-Staaten</b>	29.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Supranational</b>	29.12.2017	147,0	-	-	-	147,0	-	-	-	-	-
	31.12.2016	77,7	-	-	-	77,7	-	-	-	-	-

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)**  
**4. Quartal**

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	4. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - all</b>	29.12.2017	410,9	156,3	216,5	-	38,1
	31.12.2016	331,7	85,5	182,6	24,0	87,0
<b>Deutschland</b>	29.12.2017	280,3	151,2	105,0	-	24,1
	31.12.2016	96,9	77,8	55,0	24,0	-
<b>Irland</b>	29.12.2017	-				
	31.12.2016					
<b>Kanada</b>	29.12.2017	121,3		107,3		14,0
	31.12.2016	165,3	-	122,0	-	50,0
<b>Österreich</b>	29.12.2017	-				
	31.12.2016	37,0	-	-	-	37,0
<b>USA</b>	29.12.2017	9,3	5,1	4,2		
	31.12.2016	13,3	7,7	5,6	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

**4. Quartal**

		Deckungswerte
		Summe
		Q4/2017
		Mio. €
<b>bis zu 10 Mio €</b>	29.12.2017	441,1
	31.12.2016	358,0
<b>über 10 Mio € bis zu 100 Mio €</b>	29.12.2017	3.921,6
	31.12.2016	3.408,6
<b>mehr als 100 Mio €</b>	29.12.2017	567,6
	31.12.2016	757,1
<b>Gesamt</b>	29.12.2017	4.930,4
	31.12.2016	4.523,7