

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2018**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1/2018	Q1/2017	Q1/2018	Q1/2017	Q1/2018	Q1/2017
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	4.338,9	4.194,8	4.520,0	4.424,5	4.411,8	4.360,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-93,1	-131,8	278,9	322,5
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.371,0	5.216,5	5.804,7	5.570,3	5.391,8	5.229,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	4,9	-76,6	177,4	-33,7
Überdeckung	(Mio. €)	1.032,2	1.021,7	1.284,7	1.145,8	980,1	868,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		23,8	24,4	28,4	25,9	22,2	19,9

\* 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**

**1. Quartal**

Öffentliche Pfandbriefe			Q1/2018		Q1/2017	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
			Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	75,3	1.835,3	341,0	1.633,7
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	500,0	138,9	35,0	296,9
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	81,5	307,4	78,3	287,9
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	560,3	299,9	500,0	125,0
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	542,6	384,9	641,8	519,1
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	555,7	486,2	15,0	209,7
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	133,7	195,2	652,1	409,1
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	977,2	1.155,4	1.005,5	1.100,8
> 10 Jahre	10,0		912,7	567,9	926,2	634,4

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q1/2018**

		Q1/2018	Q1/2017
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>		(Mio. €) 4.338,9	4.194,8
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe		(in %) 97,3%	96,9%
<b>Deckungsmasse</b>		5.371,0	5.216,5
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 %) 69,0%	72,9%
<b>Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)</b>			
CAD	(Mio. €)	-4,5	-7,8
CHF	(Mio. €)	-	143,8
EUR	(Mio. €)	547,4	589,0
GBP	(Mio. €)	8,4	-54,1
JPY	(Mio. €)	11,7	13,4
NOK	(Mio. €)	-9,6	-16,0
USD	(Mio. €)	426,6	200,2
CZK	(Mio. €)	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 \*)**

**1. Quartal**

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

	Q1/2018 Mio. €	Q1/2017 Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>299,0</b>	<b>267,0</b>
davon		
<b>Niederlande</b>	<b>20,0</b>	<b>20,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	-
<b>Österreich</b>	<b>8,0</b>	<b>8,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	8,0	-
<b>Frankreich</b>	<b>0,0</b>	<b>39,5</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Norwegen</b>	<b>0,0</b>	<b>27,5</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Finland</b>	<b>105,0</b>	<b>57,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	105,0	-
<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>85,0</b>	<b>75,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	85,0	75,0
<b>Belgien</b>	<b>29,0</b>	<b>0,0</b>
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  
1. Quartal

Staat	1. 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
<b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>		29.03.2018	5.371,0	368,9	1.155,1	873,9	2.973,1	-	-	-	-
		31.03.2017	5.216,4	538,0	1.509,3	513,9	2.655,2	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>		29.03.2018	2.188,0	150,3	576,0	478,3	983,3	-	-	-	-
		31.03.2017	2.171,70	132,8	821,6	21,7	1.195,6	-	-	-	-
<b>Belgien</b>		29.03.2018	69,0	-	-	-	69,0	-	-	-	-
		31.03.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>China</b>		29.03.2018	31,7	-	-	-	31,7	-	-	-	-
		31.03.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>		29.03.2018	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-
		31.03.2017	40,0	-	-	-	40,0	-	-	-	-
<b>Finnland</b>		29.03.2018	185,2	-	-	-	185,2	-	-	-	-
		31.03.2017	72,0	-	-	-	72,0	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>		29.03.2018	79,9	-	-	-	79,9	-	-	-	-
		31.03.2017	94,1	-	-	-	94,1	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>		29.03.2018	901,7	-	-	-	901,7	-	-	-	-
		31.03.2017	570,8	-	-	-	570,8	-	-	-	-
<b>Irland</b>		29.03.2018	5,9	-	-	-	5,9	-	-	-	-
		31.03.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>		29.03.2018	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2017	107,4	107,4	-	-	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>		29.03.2018	14,9	-	-	14,9	-	-	-	-	-
		31.03.2017	17,1	-	-	17,1	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>		29.03.2018	34,7	-	-	-	34,7	-	-	-	-
		31.03.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-
<b>Kanada</b>		29.03.2018	195,6	-	181,6	-	14,0	-	-	-	-
		31.03.2017	259,3	-	209,3	-	50,0	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>		29.03.2018	193,3	-	-	-	193,3	-	-	-	-
		31.03.2017	197,5	-	-	-	197,5	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>		29.03.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		31.03.2017	27,5	-	-	-	27,5	-	-	-	-
<b>Österreich</b>		29.03.2018	66,3	37,7	-	-	28,5	-	-	-	-
		31.03.2017	97,1	42,1	-	-	55,0	-	-	-	-
<b>Polen</b>		29.03.2018	85,6	76,4	-	-	9,2	-	-	-	-
		31.03.2017	143,6	143,6	-	-	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>		29.03.2018	100,0	-	-	-	100,0	-	-	-	-
		31.03.2017	75,0	-	-	-	75,0	-	-	-	-
<b>Tschechische Republik</b>		29.03.2018	53,2	30,0	-	-	23,2	-	-	-	-
		31.03.2017	30,0	30,0	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>		29.03.2018	5,0	-	-	-	5,0	-	-	-	-
		31.03.2017	75,0	75,0	-	-	-	-	-	-	-
<b>USA</b>		29.03.2018	831,3	4,5	397,5	380,7	48,6	-	-	-	-
		31.03.2017	960,6	7,1	478,4	475,1	-	-	-	-	-
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>		29.03.2018	89,7	-	-	-	89,7	-	-	-	-
		31.03.2017	38,5	-	-	-	38,5	-	-	-	-
<b>Supranational</b>		29.03.2018	118,1	-	-	-	118,1	-	-	-	-
		31.03.2017	219,2	-	-	-	219,2	-	-	-	-

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)

1. Quartal

		Deckungswerte				
		Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
<b>Gesamtsumme - al</b>	29/03/2018	1.025,3	154,8	295,4	537,0	38,1
	31/03/2017	366,7	25,0	230,7	24,0	87,0
<b>Deutschland</b>	29/03/2018	823,3	150,3	<b>191,0</b>	457,9	24,1
	31/03/2017	146,8	17,8	105,0	24,0	-
<b>Supranational</b>	29/03/2018	75,0			<b>75,0</b>	
	31/03/2017					
<b>Kanada</b>	29/03/2018	118,4		104,4		14,0
	31/03/2017	170,3	-	120,3	-	50,0
<b>Österreich</b>	29/03/2018	-				
	31/03/2017	37,0	-	-	-	37,0
<b>USA</b>	29/03/2018	8,6	4,5		<b>4,1</b>	
	31/03/2017	12,6	7,2		<b>5,4</b>	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 PfandBG (Deutschland)

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

**1. Quartal**

		Deckungswerte
		Summe
		Q1/2018
		Mio. €
<b>bis zu 10 Mio €</b>	29/03/2018	422,2
	31/03/2017	352,8
<b>über 10 Mio € bis zu 100 Mio €</b>	29/03/2018	4.027,5
	31/03/2017	3.552,0
<b>mehr als 100 Mio €</b>	29/03/2018	921,4
	31/03/2017	1.311,7
<b>Gesamt</b>	29/03/2018	5.371,0
	31/03/2017	5.216,5