

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2018**

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4/2018	Q4/2017	Q4/2018	Q4/2017	Q4/2018	Q4/2017
<b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>	(Mio. €)	4.057,8	3.971,9	4.256,6	4.164,7	4.102,1	4.139,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-121,2	-100,9	317,2	282,0
Deckungsmasse	(Mio. €)	5.428,2	4.930,4	6.186,7	5.265,3	5.431,2	5.007,5
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	20,5	-7,3	221,4	168,4
Überdeckung	(Mio. €)	1.370,4	958,4	1.930,1	1.100,5	1.329,2	867,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		33,8	24,1	45,3	26,4	32,4	21,0

\* 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			Q4/2018		Q4/2017	
Restlaufzeit:	von in J	bis in J	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
≤ 6 Monate	0,0	0,5	-	2.112,0	45,0	2.097,2
> 6 Monate und ≤ 1 Jahr	0,5	1,0	131,8	197,2	564,4	124,6
> 1 Jahr und ≤ 18 Monate	1,0	1,5	510,0	276,1	-	153,9
> 18 Monate und ≤ 2 Jahre	1,5	2,0	15,0	222,4	173,5	176,3
> 2 Jahre und ≤ 3 Jahre	2,0	3,0	1.209,3	563,3	525,0	360,2
> 3 Jahre und ≤ 4 Jahre	3,0	4,0	130,6	231,9	638,2	445,3
> 4 Jahre und ≤ 5 Jahre	4,0	5,0	524,0	155,5	131,8	134,8
> 5 Jahre und ≤ 10 Jahre	5,0	10,0	464,0	1.173,8	981,1	862,9
> 10 Jahre	10,0		1.073,1	496,3	913,0	575,1

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

**Umlaufende Pfandbriefe (Lettres de Gage publiques) und dafür verwendete Deckungswerte | Q4/2018**

		Q4/2018	Q4/2017
<b>Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe</b>		(Mio. €) 4.057,8	3.971,9
davon Anteil festverzinsliche Pfandbriefe		(in %) 97,2%	97,1%
<b>Deckungsmasse</b>		5.428,2	4.930,4
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 %) 65,1%	61,0%
<b>Nettoarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung*)</b>			
CAD	(Mio. €)	-2,9	-5,1
CHF	(Mio. €)	-	-
EUR	(Mio. €)	985,4	549,6
GBP	(Mio. €)	37,2	17,1
JPY	(Mio. €)	12,1	11,2
NOK	(Mio. €)	-10,0	-9,1
USD	(Mio. €)	307,3	304,1
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 \*)**

**4. Quartal**

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

	Q4/2018 Mio. €	Q4/2017 Mio. €
<b>Deckungsaktiva</b>	<b>234,8</b>	<b>217,0</b>
davon		
<b>Niederlande</b>	<b>20,0</b>	<b>20,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	20,0	20,0
<b>Österreich</b>	<b>14,8</b>	<b>8,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	14,8	8,0
<b>Frankreich</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Norwegen</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	-	-
<b>Finland</b>	<b>95,0</b>	<b>72,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	95,0	72,0
<b>Dänemark</b>	<b>22,0</b>	<b>52,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	22,0	52,0
<b>Schweden</b>	<b>65,0</b>	<b>65,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	65,0	65,0
<b>Belgien</b>	<b>18,0</b>	<b>0,0</b>
davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. CRR	18,0	-

\* 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  
4. Quartal

Staat	4. Quartal	Deckungswert					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>	31.12.2018	5.428,2	182,0	971,5	939,0	3.335,7	-	-	-	-	-
	31.12.2017	4.930,4	426,0	1.245,0	434,7	2.824,7	-	-	-	-	-
<b>Deutschland</b>	31.12.2018	2.328,0	61,3	417,0	512,1	1.337,5	-	-	-	-	-
	31.12.2017	1.973,90	151,2	676,6	20,7	1.125,4	-	-	-	-	-
<b>Belgien</b>	31.12.2018	38,0	-	-	-	38,0	-	-	-	-	-
	31.12.2017	20,0	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
<b>China</b>	31.12.2018	74,9	-	-	-	74,9	-	-	-	-	-
	31.12.2017	33,4	-	-	-	33,4	-	-	-	-	-
<b>Dänemark</b>	31.12.2018	22,0	-	-	-	22,0	-	-	-	-	-
	31.12.2017	52,0	-	-	-	52,0	-	-	-	-	-
<b>Finnland</b>	31.12.2018	180,2	-	-	-	180,2	-	-	-	-	-
	31.12.2017	102,2	-	-	-	102,2	-	-	-	-	-
<b>Frankreich</b>	31.12.2018	75,3	-	-	-	75,3	-	-	-	-	-
	31.12.2017	48,9	-	-	-	48,9	-	-	-	-	-
<b>Großbritannien</b>	31.12.2018	991,2	-	-	-	991,2	-	-	-	-	-
	31.12.2017	841,4	-	-	-	841,4	-	-	-	-	-
<b>Irland</b>	31.12.2018	16,9	-	-	-	16,9	-	-	-	-	-
	31.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Italien</b>	31.12.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	70,0	70,0	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Japan</b>	31.12.2018	14,7	-	-	14,7	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	14,4	-	-	14,4	-	-	-	-	-	-
<b>Luxemburg</b>	31.12.2018	28,9	-	-	-	28,9	-	-	-	-	-
	31.12.2017	35,5	-	-	-	35,5	-	-	-	-	-
<b>Kanada</b>	31.12.2018	209,5	-	195,5	14,0	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	200,6	-	186,6	-	14,0	-	-	-	-	-
<b>Neuseeland</b>	31.12.2018	4,0	-	4,0	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Niederlande</b>	31.12.2018	149,9	-	-	-	149,9	-	-	-	-	-
	31.12.2017	148,5	-	-	-	148,5	-	-	-	-	-
<b>Norwegen</b>	31.12.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	-	-	-	-	20,0	-	-	-	-	-
<b>Österreich</b>	31.12.2018	105,6	38,4	-	-	67,1	-	-	-	-	-
	31.12.2017	62,0	39,9	-	-	22,1	-	-	-	-	-
<b>Polen</b>	31.12.2018	78,8	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	64,8	54,8	-	-	10,0	-	-	-	-	-
<b>Schweden</b>	31.12.2018	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
	31.12.2017	80,0	-	-	-	80,0	-	-	-	-	-
<b>Tschechische Republik</b>	31.12.2018	15,0	-	-	-	15,0	-	-	-	-	-
	31.12.2017	48,0	30,0	-	-	18,0	-	-	-	-	-
<b>Ungarn</b>	31.12.2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	80,2	75,0	-	-	5,2	-	-	-	-	-
<b>USA</b>	31.12.2018	756,7	3,5	355,0	398,1	-	-	-	-	-	-
	31.12.2017	813,6	5,1	381,8	399,6	27,1	-	-	-	-	-
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>	31.12.2018	144,0	-	-	-	144,0	-	-	-	-	-
	31.12.2017	94,0	-	-	-	94,0	-	-	-	-	-
<b>Supranational</b>	31.12.2018	114,7	-	-	-	114,7	-	-	-	-	-
	31.12.2017	147,0	-	-	-	147,0	-	-	-	-	-

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 - al</b>	31/12/2018	1.076,5	64,8	187,4	510,5	313,9
	31/12/2017	370,7	123,5	172,2	24,0	51,0
<b>Deutschland</b>	31/12/2018	889,6	61,3	75,0	492,8	260,6
	31/12/2017	196,2	117,2	55,0	24,0	-
<b>Kanada</b>	31/12/2018	126,4	-	112,4	14,0	-
	31/12/2017	126,7	-	112,7	-	14,0
<b>VAE</b>	31/12/2018	53,3	-	-	-	53,3
	31/12/2017	37,0	-	-	-	37,0
<b>USA</b>	31/12/2018	7,2	3,5	-	3,7	-
	31/12/2017	10,8	6,3	-	4,5	-
<b>Luxemburg</b>	31/12/2018	-	-	-	-	-
	31/12/2017	-	-	-	-	-

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
		Q4/2018
		Mio. €
<b>bis zu 10 Mio €</b>	31/12/2018	348,5
	31/12/2017	441,1
<b>über 10 Mio € bis zu 100 Mio €</b>	31/12/2018	3.967,2
	31/12/2017	3.921,6
<b>mehr als 100 Mio €</b>	31/12/2018	1.112,5
	31/12/2017	567,6
<b>Gesamt</b>	31/12/2018	5.428,2
	31/12/2017	4.930,3