



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 30. September 2021

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	16
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20

Aufgrund von Rundungen können sich im vorliegenden Bericht bei Summenbildungen und bei der Berechnung von Prozentangaben geringfügige Abweichungen ergeben.

Gesamtbetrag der umlaufenden Hypothekendarlehen und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Pfandbriefumlauf	10.155,7	2.114,2	10.537,3	2.285,2	9.639,5	2.025,4	11.609,9	2.622,7	9.639,5	2.025,4
Deckungsmasse	12.891,2	5.272,6	13.903,6	5.745,9	12.600,4	5.322,2	15.581,8	6.404,4	12.533,1	5.320,7
Überdeckung	2.735,5	3.158,3	3.366,4	3.460,7	2.960,9	3.296,8	3.971,9	3.781,6	2.893,6	3.295,3
Überdeckung in %	26,9	149,4	31,9	151,4	30,7	162,8	34,2	144,2	30,0	162,7

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2021	Q3 / 2020
CHF	20,7	16,5
GBP	719,1	-

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q3 / 2021	-	29,9	-	167,6	197,5
	Q3 / 2020	-	126,5	-	-	126,5
Belgien	Q3 / 2021	-	-	-	12,3	12,3
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-
Italien	Q3 / 2021	-	-	-	15,0	15,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-
Japan	Q3 / 2021	-	-	-	149,0	149,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Luxemburg	Q3 / 2021	-	-	-	143,0	143,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-
Niederlande	Q3 / 2021	-	49,9	-	-	49,9
	Q3 / 2020	-	20,0	-	-	20,0
USA	Q3 / 2021	-	-	-	45,0	45,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-

Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Pfandbriefumlauf	10.155,7	2.114,2
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	97,28	83,34
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	12.891,2	5.272,6
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	78,57	76,91
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen des § 13 Abs. 1 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt der seit der Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit in Jahren	6,0	7,4
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2021		Q3 / 2020	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	658,0	1.456,3	25,0	740,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.340,0	740,0	134,2	273,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	799,0	956,6	113,8	282,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	408,6	655,8	10,0	259,8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.433,0	1.400,0	455,1	608,1
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.290,5	1.418,9	125,0	554,5
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.515,0	1.711,7	6,0	544,2
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.461,5	3.468,4	1.195,0	1.728,2
mehr als 10 Jahre	250,1	1.083,5	50,1	281,6
Gesamt	10.155,7	12.891,2	2.114,2	5.272,6

Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
bis zu 300 Tsd €	1.301,1	1.301,5
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	578,2	575,2
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	3.323,5	2.108,0
mehr als 10 Mio €	7.076,6	1.141,4
Gesamt	12.279,4	5.126,0

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					Gesamt
		Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q3 / 2021	257,9	850,3	2.481,7	-	-	3.589,9
	Q3 / 2020	248,9	845,2	2.531,6	-	1,9	3.627,6
Belgien	Q3 / 2021	-	-	7,5	-	-	7,5
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Q3 / 2021	4,9	14,6	189,5	-	-	209,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Q3 / 2021	-	-	22,0	-	-	22,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Irland	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					Gesamt
		Eigentumswohnungen	Ein- und Zweifamilienhäuser	Mehrfamilienhäuser	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Niederlande	Q3 / 2021	-	53,1	1.021,7	-	-	1.074,8
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q3 / 2021	-	-	24,6	-	-	24,6
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Polen	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Spanien	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q3 / 2021	262,8	918,0	3.747,1	-	-	4.927,9
	Q3 / 2020	248,9	845,2	2.531,6	-	1,9	3.627,6

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q3 / 2021	1.745,1	1.913,7	119,0	874,6	156,9	65,6	4.874,8
	Q3 / 2020	381,9	330,2	83,9	627,4	-	-	1.423,5
Belgien	Q3 / 2021	-	25,6	-	-	-	-	25,6
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Q3 / 2021	237,0	207,3	-	40,1	-	-	484,4
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Q3 / 2021	285,6	354,8	-	14,6	48,6	-	703,5
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Irland	Q3 / 2021	24,0	18,4	-	-	-	-	42,4
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Luxemburg	Q3 / 2021	96,5	-	-	-	-	-	96,5
	Q3 / 2020	75,0	-	-	-	-	-	75,0

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Niederlande	Q3 / 2021	217,1	228,2	-	157,4	-	-	602,7
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Q3 / 2021	80,2	7,9	-	-	-	-	88,1
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Polen	Q3 / 2021	157,1	183,8	-	22,5	-	-	363,4
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Spanien	Q3 / 2021	16,7	47,2	-	6,3	-	-	70,2
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q3 / 2021	2.859,3	2.986,8	119,0	1.115,4	205,5	65,6	7.351,5
	Q3 / 2020	456,9	330,2	83,9	627,4	-	-	1.498,5

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Deutschland	Q3 / 2021	0,0	0,1
	Q3 / 2020	0,1	0,2
Belgien	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Frankreich	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Großbritannien	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Irland	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Luxemburg	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Niederlande	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Österreich	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Polen	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Spanien	Q3 / 2021	-	-
	Q3 / 2020	-	-
Gesamt	Q3 / 2021	0,0	0,1
	Q3 / 2020	0,1	0,2

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	16
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	26

Gesamtbetrag der umlaufenden Öffentlichen Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Pfandbriefumlauf	12.219,6	11.019,4	14.818,8	13.498,2	12.765,1	11.626,7	17.561,5	15.962,1	12.755,0	11.625,0
Deckungsmasse	15.870,5	14.870,9	20.233,2	17.670,1	17.308,7	15.349,4	24.410,0	21.037,5	17.231,1	15.318,1
Überdeckung	3.650,8	3.851,5	5.414,4	4.171,9	4.543,6	3.722,7	6.848,5	5.075,4	4.476,1	3.693,1
Überdeckung in %	29,9	35,0	36,5	30,9	35,6	32,0	39,0	31,8	35,1	31,8

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2021	Q3 / 2020
CHF	71,0	-
GBP	134,4	-
JPY	60,2	13,1
USD	232,7	164,4

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe gemäß § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Deutschland	Q3 / 2021	-	413,0	165,0	413,0
	Q3 / 2020	-	788,8	185,0	788,8
Niederlande	Q3 / 2021	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-

Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Pfandbriefumlauf	12.219,6	11.019,4
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	95,81	96,44
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	15.870,5	14.870,9
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	77,30	89,55
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten	-	-

Laufzeitstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2021		Q3 / 2020	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	411,9	1.105,8	1.531,4	1.299,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	273,2	691,3	289,3	760,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	539,1	847,7	220,6	614,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	426,7	538,4	200,8	808,4
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	594,6	1.649,5	715,8	1.291,9
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.067,1	1.160,7	423,5	1.276,6
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	935,2	1.671,3	894,2	1.056,4
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	5.637,4	4.122,4	4.668,2	4.497,8
mehr als 10 Jahre	2.334,6	4.083,4	2.075,6	3.264,9
Gesamt	12.219,6	15.870,5	11.019,4	14.870,9

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
bis zu 10 Mio €	2.821,9	2.883,8
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	6.562,6	5.224,3
mehr als 100 Mio €	6.073,0	5.974,1
Gesamt	15.457,5	14.082,1

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern (inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskör- perschaft	Örtliche Gebietskör- perschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskör- perschaft	Örtliche Gebietskör- perschaft	Sonstige		
Deutschland	Q3 / 2021	11.905,9	55,0	3.745,0	5.355,4	2.750,5	1.596,0	232,5	557,8	627,0	178,6	(201,6)	13.501,9
	Q3 / 2020	11.664,9	45,0	3.320,2	5.593,5	2.706,3	1.649,0	414,8	402,8	583,1	248,2	(383,3)	13.313,9
Belgien	Q3 / 2021	75,0	-	75,0	-	-	212,0	-	125,0	-	87,0	(87,0)	287,0
	Q3 / 2020	10,0	-	-	-	10,0	53,4	-	-	-	53,4	(53,4)	63,4
Dänemark	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	70,4	-	-	-	70,4	(50,0)	70,4
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	37,5	-	-	-	37,5	(37,5)	37,5
Finnland	Q3 / 2021	13,4	-	-	8,4	5,0	-	-	-	-	-	(-)	13,4
	Q3 / 2020	5,0	-	-	-	5,0	-	-	-	-	-	(-)	5,0
Frankreich	Q3 / 2021	11,9	-	-	-	11,9	246,4	246,4	-	-	-	(61,1)	258,4
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	255,3	255,3	-	-	-	(65,0)	255,3
Großbritannien	Q3 / 2021	58,1	-	-	-	58,1	2,8	2,8	-	-	-	(2,8)	60,9
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	11,0	11,0	-	-	-	(11,0)	11,0
Italien	Q3 / 2021	44,2	37,2	5,0	2,0	-	-	-	-	-	-	(-)	44,2
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Japan	Q3 / 2021	10,0	-	-	10,0	-	-	-	-	-	-	(-)	10,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Kanada	Q3 / 2021	43,6	-	13,8	-	29,7	-	-	-	-	-	(-)	43,6
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	0,8	0,8	-	-	-	(-)	0,8
Lettland	Q3 / 2021	29,0	-	-	29,0	-	-	-	-	-	-	(-)	29,0
	Q3 / 2020	22,9	-	-	22,9	-	-	-	-	-	-	(-)	22,9

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern (inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		
Luxemburg	Q3 / 2021	183,4	-	-	-	183,4	-	-	-	-	-	(-)	183,4
	Q3 / 2020	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-	(-)	10,0
Niederlande	Q3 / 2021	21,1	21,1	-	-	-	29,9	29,9	-	-	-	(29,9)	51,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	34,1	34,1	-	-	-	(34,1)	34,1
Österreich	Q3 / 2021	436,3	429,9	-	6,4	-	8,6	8,6	-	-	-	(8,6)	444,8
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	12,8	12,8	-	-	-	(12,8)	12,8
Polen	Q3 / 2021	30,8	30,8	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	30,8
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Schweden	Q3 / 2021	8,0	-	-	8,0	-	-	-	-	-	-	(-)	8,0
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
Schweiz	Q3 / 2021	69,3	-	69,3	-	-	12,6	-	-	-	12,6	(12,6)	81,8
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	14,2	-	-	-	14,2	(14,2)	14,2
Spanien	Q3 / 2021	31,2	-	15,0	-	16,2	-	-	-	-	-	(-)	31,2
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(-)	-
USA	Q3 / 2021	83,0	-	83,0	-	-	224,7	152,8	-	-	71,9	(152,8)	307,7
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	300,9	213,5	-	-	87,4	(213,5)	300,9
Gesamt	Q3 / 2021	13.054,2	574,0	4.006,1	5.419,2	3.054,9	2.403,3	673,0	682,8	627,0	420,4	(606,3)	15.457,5
	Q3 / 2020	11.712,9	45,0	3.320,2	5.616,4	2.731,3	2.369,2	942,4	402,8	583,1	440,8	(824,9)	14.082,1

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Deutschland	Q3 / 2021	5,3	-	-	-	(5,3)	3,5	-	-	-	(3,5)
	Q3 / 2020	3,5	-	-	-	(3,5)	5,3	-	-	-	(5,3)
Belgien	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Dänemark	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Finnland	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Frankreich	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Großbritannien	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Italien	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Japan	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Kanada	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Lettland	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Luxemburg	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Niederlande	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Österreich	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Polen	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweden	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweiz	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Spanien	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
USA	Q3 / 2021	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2020	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Gesamt	Q3 / 2021	5,3	-	-	-	(5,3)	3,5	-	-	-	(3,5)
	Q3 / 2020	3,5	-	-	-	(3,5)	5,3	-	-	-	(5,3)

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	16
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	26

Gesamtbetrag der umlaufenden Schiffspfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Pfandbriefumlauf	30,5	33,1	31,2	34,6	31,0	33,9	31,5	35,4	31,0	33,9
Deckungsmasse	40,0	40,0	40,8	41,3	38,6	38,4	44,7	46,4	38,6	38,4
Überdeckung	9,5	6,9	9,6	6,7	7,5	4,5	13,2	11,0	7,5	4,5
Überdeckung in %	31,1	20,8	30,8	19,3	24,3	13,1	41,9	31,2	24,3	13,1

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2021	Q3 / 2020
	-	-

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe gemäß § 26 Abs. 1 Nr. 2, Nr. 3 und Nr. 4 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2	Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q3 / 2021	-	-	-	40,0	40,0
	Q3 / 2020	-	-	-	40,0	40,0

Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Pfandbriefumlauf	30,5	33,1
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	67,21	69,79
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	40,0	40,0
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	57,50	57,50
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	30,4	-

Laufzeitstruktur der Schiffspfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2021		Q3 / 2020	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	20,0	-	12,6	-
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	10,5	-	-	-
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	-	-	20,0	-
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	-	-	0,5	-
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	-	10,0	-	-
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	-	20,0	-	10,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	-	-	-	20,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	-	10,0	-	10,0
mehr als 10 Jahre	-	-	-	-
Gesamt	30,5	40,0	33,1	40,0

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
bis zu 500 Tsd €	-	-
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	-	-
mehr als 5 Mio €	-	-
Gesamt	-	-

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach See- und Binnenschiffen

in Mio €		Seeschiffe					Binnenschiffe	Gesamt
		Gesamt	davon					
			Bulker	Containerschiff	Mehrzweckfrachter	Tanker		
Deutschland	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q3 / 2021	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2020	-	-	-	-	-	-	-

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q3 / 2021	Q3 / 2020
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	-	-