



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 30. September 2018

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten

3

Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten

12

Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten

20

Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten

28

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 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	4.054,2	2.694,7	4.111,3	2.770,1	3.777,3	2.627,8	4.609,4	2.806,6	3.777,3	2.627,8
Deckungsmasse	5.544,1	5.265,6	5.990,5	5.742,2	5.548,8	5.314,2	6.565,1	5.819,8	5.548,7	5.314,1
Überdeckung	1.489,9	2.570,9	1.879,2	2.972,1	1.771,5	2.686,4	1.955,7	3.013,2	1.771,4	2.686,3
Überdeckung in %	36,7	95,4	45,7	107,3	46,9	102,2	42,4	107,4	46,9	102,2

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2018	Q3 / 2017
USD	0,8	0,8

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 / 2018	-	74,0	-	445,0	519,0
	Q3 / 2017	-	-	-	95,0	95,0

Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	4.054,2	2.694,7
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	47,28	36,75
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	5.544,1	5.265,6
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	79,76	76,80
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	7,2	7,1
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2018		Q3 / 2017	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	118,8	450,1	110,0	637,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	997,4	442,3	32,0	276,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	136,0	260,7	575,1	306,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	550,0	321,6	595,7	300,9
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	132,0	655,7	566,0	514,9
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	261,8	523,1	171,8	548,8
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	455,1	669,4	115,0	424,8
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.246,0	1.999,5	407,0	1.948,5
mehr als 10 Jahre	157,1	221,7	122,1	307,5
Gesamt	4.054,2	5.544,1	2.694,7	5.265,6

Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
bis zu 300 Tsd €	1.315,7	1.380,4
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	557,0	564,4
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	2.007,3	2.003,1
mehr als 10 Mio €	1.145,1	1.222,7
Gesamt	5.025,1	5.170,6

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

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					
		Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familienhäuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und nicht ertrags- fähige Neubauten	Bauplätze	Gesamt
Deutschland	Q3 / 2018	240,6	856,0	2.363,3	-	1,2	3.461,1
	Q3 / 2017	248,2	894,6	2.415,9	-	0,8	3.559,5
Luxemburg	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q3 / 2018	240,6	856,0	2.363,3	-	1,2	3.461,1
	Q3 / 2017	248,2	894,6	2.415,9	-	0,8	3.559,5

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 / 2018	362,1	360,3	102,5	663,6	-	0,5	1.489,0
	Q3 / 2017	370,0	342,7	72,1	684,9	-	0,5	1.470,2
Luxemburg	Q3 / 2018	75,0	-	-	-	-	-	75,0
	Q3 / 2017	140,9	-	-	-	-	-	140,9
Gesamt	Q3 / 2018	437,1	360,3	102,5	663,6	-	0,5	1.564,0
	Q3 / 2017	510,9	342,7	72,1	684,9	-	0,5	1.611,1

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
Deutschland	Q3 / 2018	0,4	-
	Q3 / 2017	0,0	0,2
Luxemburg	Q3 / 2018	-	-
	Q3 / 2017	-	-
Gesamt	Q3 / 2018	0,4	-
	Q3 / 2017	0,0	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	12
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20
Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten	28

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 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	15.921,3	16.941,3	18.030,1	19.284,2	15.828,4	16.890,6	21.014,6	20.288,2	16.045,3	17.243,5
Deckungsmasse	17.878,3	19.155,2	20.073,5	21.519,4	17.621,5	18.896,3	23.528,6	22.677,6	17.687,1	18.982,2
Überdeckung	1.957,0	2.213,9	2.043,4	2.235,2	1.793,1	2.005,7	2.514,0	2.389,4	1.641,8	1.738,7
Überdeckung in %	12,3	13,1	11,3	11,6	11,3	11,9	12,0	11,8	10,2	10,1

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2018	Q3 / 2017
GBP	15,4	-
USD	-599,7	-1.075,4

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 Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Deutschland	Q3 / 2018	-	902,2	185,0	902,2
	Q3 / 2017	-	512,2	185,0	512,2

Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	15.921,3	16.941,3
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	95,27	92,68
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	17.878,3	19.155,2
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	87,84	84,84
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 / 2018		Q3 / 2017	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	798,0	641,2	1.087,1	1.480,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	2.607,4	1.788,2	656,3	968,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	872,5	941,2	3.127,5	922,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	362,5	872,1	461,3	820,8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.695,0	1.489,3	1.219,8	1.842,4
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	343,1	1.353,8	1.570,7	1.350,7
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	746,8	1.167,0	370,2	1.839,7
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	4.502,1	5.458,0	4.238,6	5.394,6
mehr als 10 Jahre	3.993,9	4.167,5	4.209,8	4.535,0
Gesamt	15.921,3	17.878,3	16.941,3	19.155,2

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
bis zu 10 Mio €	3.066,3	2.922,1
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	6.100,7	6.450,9
mehr als 100 Mio €	7.809,1	9.270,0
Gesamt	16.976,1	18.643,0

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		
Deutschland	Q3 / 2018	13.809,7	125,0	3.616,8	6.407,1	3.660,8	2.035,0	615,1	520,2	682,0	217,7	(539,1)	15.844,7
	Q3 / 2017	15.257,0	140,0	4.113,1	6.204,8	4.799,1	2.268,5	687,0	545,9	742,0	293,6	(618,4)	17.525,5
Belgien	Q3 / 2018	30,0	-	-	-	30,0	70,5	-	-	-	70,5	(70,5)	100,5
	Q3 / 2017	30,0	-	-	-	30,0	21,0	-	-	-	21,0	(21,0)	51,0
Dänemark	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	64,1	-	-	-	64,1	(64,1)	64,1
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	69,0	-	-	-	69,0	(69,0)	69,0
Finnland	Q3 / 2018	5,0	-	-	-	5,0	23,8	-	-	-	23,8	(23,8)	28,8
	Q3 / 2017	5,0	-	-	-	5,0	41,7	-	-	-	41,7	(41,7)	46,7
Frankreich	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	325,9	325,9	-	-	-	(55,1)	325,9
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	111,6	111,6	-	-	-	(26,4)	111,6
Großbritannien	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	27,4	27,4	-	-	-	(27,4)	27,4
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	34,7	34,7	-	-	-	(34,7)	34,7
Kanada	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	15,7	15,7	-	-	-	(-)	15,7
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	24,0	24,0	-	-	-	(-)	24,0
Lettland	Q3 / 2018	29,5	-	-	29,5	-	-	-	-	-	-	(-)	29,5
	Q3 / 2017	32,5	-	-	32,5	-	-	-	-	-	-	(-)	32,5
Luxemburg	Q3 / 2018	10,0	-	-	-	10,0	-	-	-	-	-	(-)	10,0
	Q3 / 2017	35,0	-	-	-	35,0	-	-	-	-	-	(-)	35,0
Niederlande	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	42,7	42,7	-	-	-	(42,7)	42,7
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	46,9	46,9	-	-	-	(46,9)	46,9
Österreich	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	31,8	31,8	-	-	-	(31,8)	31,8
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	151,8	151,8	-	-	-	(41,3)	151,8
Schweiz	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	12,0	-	-	-	12,0	(12,0)	12,0
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	6,0	-	-	-	6,0	(6,0)	6,0
USA	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	443,0	331,5	-	-	111,5	(331,5)	443,0
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	508,3	388,8	-	-	119,5	(388,8)	508,3
Gesamt	Q3 / 2018	13.884,2	125,0	3.616,8	6.436,6	3.705,8	3.091,9	1.390,1	520,2	682,0	499,6	(1.198,0)	16.976,1
	Q3 / 2017	15.359,5	140,0	4.113,1	6.237,3	4.869,1	3.283,5	1.444,8	545,9	742,0	550,8	(1.294,2)	18.643,0

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 / 2018	-	-	0,0	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	60,7	-	-	-	(60,7)	28,9	-	-	-	(28,9)
Belgien	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Dänemark	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Finnland	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Frankreich	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Großbritannien	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Kanada	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Lettland	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Luxemburg	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Niederlande	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Österreich	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Schweiz	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
USA	Q3 / 2018	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	-	-	-	-	(-)	-	-	-	-	(-)
Gesamt	Q3 / 2018	-	-	0,0	-	(-)	-	-	-	-	(-)
	Q3 / 2017	60,7	-	-	-	(60,7)	28,9	-	-	-	(28,9)

* 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	12
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20
Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten	28

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 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	43,1	106,1	47,1	111,7	44,8	107,6	50,2	111,7	44,8	107,6
Deckungsmasse	219,2	392,4	231,9	421,6	228,8	414,9	235,3	423,9	197,9	363,0
Überdeckung	176,1	286,3	184,8	309,9	184,0	307,3	185,1	312,2	153,1	255,4
Überdeckung in %	408,6	269,8	392,4	277,4	410,7	285,6	368,7	279,5	341,7	237,4

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2018	Q3 / 2017
USD	185,2	311,1

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 / 2018	-	5,0	-	25,0	30,0
	Q3 / 2017	-	-	-	92,8	92,8

Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	43,1	106,1
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	76,80	62,30
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	219,2	392,4
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	7,17	18,56
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	-	-

Laufzeitstruktur der Schiffspfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2018		Q3 / 2017	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	-	45,2	30,0	22,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	-	23,6	33,0	66,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	10,0	43,4	-	47,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	-	13,1	-	32,9
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	2,6	43,9	10,0	69,4
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	30,5	28,0	2,6	56,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	-	12,4	30,5	36,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	-	9,6	-	59,1
mehr als 10 Jahre	-	-	-	2,4
Gesamt	43,1	219,2	106,1	392,4

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
bis zu 500 Tsd €	1,9	1,0
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	68,0	124,7
mehr als 5 Mio €	119,3	173,9
Gesamt	189,2	299,6

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

in Mio €		Seeschiffe						Binnen- schiffe	Gesamt
		Gesamt	davon						
			Bulker	Container- schiff	Mehrzweck- frachter	Tanker	Sonstige		
Deutschland	Q3 / 2018	118,2	7,0	19,4	36,1	55,7	-	-	118,2
	Q3 / 2017	175,7	2,9	38,8	51,9	65,6	16,5	-	175,7
Antigua und Barbuda	Q3 / 2018	2,3	-	-	-	-	2,3	-	2,3
	Q3 / 2017	3,2	-	-	-	-	3,2	-	3,2
Gibraltar	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2017	0,3	-	-	-	0,3	-	-	0,3
Großbritannien	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2017	28,8	-	-	-	-	28,8	-	28,8
Kroatien	Q3 / 2018	22,6	-	-	-	22,6	-	-	22,6
	Q3 / 2017	23,5	-	-	-	23,5	-	-	23,5
Liberia	Q3 / 2018	2,0	-	2,0	-	-	-	-	2,0
	Q3 / 2017	2,7	-	2,2	-	0,5	-	-	2,7
Malta	Q3 / 2018	24,8	13,0	-	-	11,8	-	-	24,8
	Q3 / 2017	30,9	13,6	-	-	17,3	-	-	30,9
Marshall-Inseln	Q3 / 2018	13,6	4,8	-	-	8,8	-	-	13,6
	Q3 / 2017	34,5	6,5	-	-	28,0	-	-	34,5
Schweden	Q3 / 2018	5,7	-	-	-	-	5,7	-	5,7
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	-	-	-
Gesamt	Q3 / 2018	189,2	24,8	21,4	36,1	98,9	8,0	-	189,2
	Q3 / 2017	299,6	23,0	41,0	51,9	135,2	48,5	-	299,6

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	5,5	1,2
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	21,4	7,9

* 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	12
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20
Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten	28

Gesamtbetrag der umlaufenden Flugzeugpfandbriefe 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 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	505,0	505,0	517,0	518,0	511,9	500,5	522,3	516,5	511,9	500,5
Deckungsmasse	1.273,0	949,0	1.392,7	1.031,3	1.297,3	987,5	1.510,4	1.064,0	1.195,9	852,2
Überdeckung	768,0	444,0	875,7	513,3	785,4	487,0	988,1	547,5	684,0	351,7
Überdeckung in %	152,1	87,9	169,4	99,1	153,4	97,3	189,2	106,0	133,6	70,3

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2018	Q3 / 2017
GBP	47,4	18,1
USD	582,4	801,8

Weitere Deckungswerte für Flugzeugpfandbriefe gemäß § 26f 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. § 26f Abs. 1 Nr. 2	Forderungen i.S.d. § 26f Abs. 1 Nr. 3		Forderungen i.S.d. § 26f Abs. 1 Nr. 4	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i. S. d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q3 / 2018	-	40,0	-	450,9	490,9
	Q3 / 2017	-	-	-	40,0	40,0

Flugzeugpfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Pfandbriefumlauf	505,0	505,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	100,00	100,00
Anteil Derivate	-	-
Deckungsmasse	1.273,0	949,0
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	74,36	54,04
Anteil Derivate	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26f Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26f Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	-	-

Laufzeitstruktur der Flugzeugpfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2018		Q3 / 2017	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	500,0	156,9	-	99,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	-	136,2	-	117,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	5,0	68,1	500,0	102,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	-	109,5	-	64,7
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	-	229,6	5,0	164,3
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	-	81,2	-	109,4
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	-	68,1	-	71,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	-	314,4	-	179,9
mehr als 10 Jahre	-	109,0	-	40,3
Gesamt	505,0	1.273,0	505,0	949,0

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
bis zu 500 Tsd €	0,9	0,4
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	89,5	93,2
mehr als 5 Mio €	691,7	815,4
Gesamt	782,1	909,0

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach Flugzeugtypen

in Mio €		Business Jet	Freighter	Narrowbody	Regional Jet	Turboprop	Ultralarge	Widebody	Gesamt
Deutschland	Q3 / 2018	-	100,5	-	-	13,9	-	-	114,4
	Q3 / 2017	-	107,8	31,8	-	16,4	-	-	156,0
Finnland	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	-	31,0	31,0
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	-	34,4	34,4
Frankreich	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	48,9	29,5	78,4
	Q3 / 2017	-	-	-	-	-	62,5	31,7	94,2
Großbritannien	Q3 / 2018	-	-	20,3	6,6	74,8	69,5	-	171,2
	Q3 / 2017	-	-	18,8	8,0	33,2	36,4	-	96,4
Irland	Q3 / 2018	-	-	1,1	-	44,9	-	32,5	78,5
	Q3 / 2017	-	-	48,2	-	-	-	36,3	84,5
Luxemburg	Q3 / 2018	-	-	-	-	-	-	-	-
	Q3 / 2017	-	4,8	-	-	-	-	-	4,8
Schweiz	Q3 / 2018	-	-	9,3	-	-	-	-	9,3
	Q3 / 2017	-	-	28,5	-	-	-	-	28,5
USA	Q3 / 2018	-	87,2	167,1	45,0	-	-	-	299,3
	Q3 / 2017	-	93,0	258,5	58,7	-	-	-	410,2
Gesamt	Q3 / 2018	-	187,7	197,8	51,6	133,6	118,4	93,0	782,1
	Q3 / 2017	-	205,6	385,8	66,7	49,6	98,9	102,4	909,0

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q3 / 2018	Q3 / 2017
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	-	-