



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 30. September 2016

# 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 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015
Pfandbriefumlauf	1.905,6	1.877,6	1.947,8	1.922,7	1.882,7	1.879,2	1.945,0	1.929,1	1.882,7	1.879,2
Deckungsmasse	3.285,0	3.173,6	3.648,9	3.495,4	3.370,9	3.241,5	3.644,4	3.550,9	3.354,4	3.231,0
Überdeckung	1.379,4	1.296,0	1.701,1	1.572,7	1.488,2	1.362,3	1.699,4	1.621,8	1.471,7	1.351,8
Überdeckung in %	72,4	69,0	87,3	81,8	79,0	72,5	87,4	84,1	78,2	71,9

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2016	Q3 / 2015
CHF	0,0	6,3
USD	98,9	59,6

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 / 2016	0,0	0,0	0,0	75,0	75,0
	Q3 / 2015	0,0	10,0	0,0	65,0	75,0

## Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>1.905,6</b>	<b>1.877,6</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	18,76	24,24
Anteil Derivate	0,0	0,0
<b>Deckungsmasse</b>	<b>3.285,0</b>	<b>3.173,6</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	80,15	76,53
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen des § 13 Abs. 1 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	0,0	0,0
Volumengewichteter Durchschnitt der seit der Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit in Jahren	7,3	6,8
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

## Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2016		Q3 / 2015	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	70,0	560,5	95,0	493,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	0,0	153,1	52,5	182,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	70,0	238,8	70,0	255,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	175,7	0,0	135,1
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	918,1	421,8	70,0	300,4
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	500,0	253,8	1.017,6	473,6
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	75,0	285,8	500,0	221,7
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	272,5	1.111,1	72,5	1.016,9
mehr als 10 Jahre	0,0	84,4	0,0	94,2
<b>Gesamt</b>	<b>1.905,6</b>	<b>3.285,0</b>	<b>1.877,6</b>	<b>3.173,6</b>

## Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
bis zu 300 Tsd €	1.088,0	1.118,2
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	299,9	291,2
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	1.021,0	795,6
mehr als 10 Mio €	801,1	893,6
<b>Gesamt</b>	<b>3.210,0</b>	<b>3.098,6</b>

## 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 / 2016	184,1	714,2	1.447,8	0,0	0,5	<b>2.346,6</b>
	Q3 / 2015	195,9	714,4	1.225,9	0,0	0,1	<b>2.136,3</b>
Luxemburg	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
Österreich	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
USA	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>184,1</b>	<b>714,2</b>	<b>1.447,8</b>	<b>0,0</b>	<b>0,5</b>	<b>2.346,6</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>195,9</b>	<b>714,4</b>	<b>1.225,9</b>	<b>0,0</b>	<b>0,1</b>	<b>2.136,3</b>



## 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 / 2016	251,3	155,3	4,6	204,0	0,0	0,0	<b>615,2</b>
	Q3 / 2015	304,1	225,6	7,8	216,0	0,0	0,1	<b>753,6</b>
Luxemburg	Q3 / 2016	143,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>143,5</b>
	Q3 / 2015	143,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>143,5</b>
Österreich	Q3 / 2016	0,0	7,9	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>7,9</b>
	Q3 / 2015	0,0	8,3	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>8,3</b>
USA	Q3 / 2016	96,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>96,8</b>
	Q3 / 2015	56,9	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>56,9</b>
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>491,6</b>	<b>163,2</b>	<b>4,6</b>	<b>204,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>863,4</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>504,5</b>	<b>233,9</b>	<b>7,8</b>	<b>216,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,1</b>	<b>962,3</b>

## 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 / 2016	0,0	0,1
	Q3 / 2015	0,0	0,1
Luxemburg	Q3 / 2016	0,0	0,0
	Q3 / 2015	0,0	0,0
Österreich	Q3 / 2016	0,0	0,0
	Q3 / 2015	0,0	0,0
USA	Q3 / 2016	0,0	0,0
	Q3 / 2015	0,0	0,0
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>0,0</b>	<b>0,1</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>0,0</b>	<b>0,1</b>

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

# Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
<b>Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten</b>	<b>12</b>
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 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015
Pfandbriefumlauf	13.361,9	16.585,1	16.228,2	19.222,6	14.190,7	17.076,0	16.527,2	20.158,4	14.577,6	17.667,0
Deckungsmasse	18.153,8	19.733,8	21.353,7	22.542,0	18.884,1	20.074,1	21.706,7	23.625,1	19.017,7	20.183,9
Überdeckung	4.791,9	3.148,7	5.125,5	3.319,4	4.693,4	2.998,1	5.179,5	3.466,7	4.440,1	2.516,9
Überdeckung in %	35,9	19,0	31,6	17,3	33,1	17,6	31,3	17,2	30,5	14,2

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2016	Q3 / 2015
CHF	2,9	1,9
JPY	-71,9	-137,1
USD	-944,9	-1.879,3

## 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 / 2016	0,0	608,1	70,0	608,1
	Q3 / 2015	0,0	567,0	70,0	567,0

## Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>13.361,9</b>	<b>16.585,1</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	92,00	89,46
Anteil Derivate	0,0	0,0
<b>Deckungsmasse</b>	<b>18.153,8</b>	<b>19.733,8</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	83,40	86,28
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten	0,0	0,0

## Laufzeitstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2016		Q3 / 2015	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	364,8	1.499,7	1.783,5	1.726,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	604,5	1.363,6	1.589,9	901,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	947,9	1.001,4	353,0	1.452,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	425,8	827,9	614,5	1.444,3
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	3.382,0	1.540,5	1.148,1	1.831,7
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	937,0	1.776,0	3.440,5	1.331,9
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.411,1	1.161,6	959,5	1.838,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.722,2	4.873,1	3.026,8	5.004,8
mehr als 10 Jahre	3.566,6	4.110,0	3.669,3	4.202,3
<b>Gesamt</b>	<b>13.361,9</b>	<b>18.153,8</b>	<b>16.585,1</b>	<b>19.733,8</b>

## Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
bis zu 10 Mio €	1.809,4	1.894,3
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	5.026,6	5.107,3
mehr als 100 Mio €	10.709,7	12.165,2
<b>Gesamt</b>	<b>17.545,7</b>	<b>19.166,8</b>



## 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 / 2016	<b>14.632,6</b>	610,0	4.831,8	4.086,2	5.104,6	<b>1.787,6</b>	650,9	504,8	568,4	63,5	(582,7)	<b>16.420,2</b>
	Q3 / 2015	<b>16.321,1</b>	640,0	5.607,3	4.138,7	5.935,1	<b>1.792,6</b>	626,3	556,4	544,3	65,6	(544,2)	<b>18.113,7</b>
Belgien	Q3 / 2016	<b>30,0</b>	0,0	0,0	0,0	30,0	<b>24,9</b>	0,0	0,0	0,0	24,9	(24,9)	<b>54,9</b>
	Q3 / 2015	<b>134,0</b>	0,0	0,0	0,0	134,0	<b>24,4</b>	0,0	0,0	0,0	24,4	(24,4)	<b>158,4</b>
Dänemark	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>73,0</b>	0,0	0,0	0,0	73,0	(73,0)	<b>73,0</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>32,9</b>	0,0	0,0	0,0	32,9	(32,9)	<b>32,9</b>
Finnland	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>56,0</b>	0,0	0,0	0,0	56,0	(56,0)	<b>56,0</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>69,2</b>	0,0	0,0	0,0	69,2	(69,2)	<b>69,2</b>
Frankreich	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>64,5</b>	64,5	0,0	0,0	0,0	(64,5)	<b>64,5</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>45,1</b>	45,1	0,0	0,0	0,0	(45,1)	<b>45,1</b>
Großbritannien	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>44,8</b>	44,8	0,0	0,0	0,0	(44,8)	<b>44,8</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>52,6</b>	52,6	0,0	0,0	0,0	(52,6)	<b>52,6</b>
Kanada	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>34,1</b>	34,1	0,0	0,0	0,0	(0,0)	<b>34,1</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>75,7</b>	75,7	0,0	0,0	0,0	(0,0)	<b>75,7</b>
Lettland	Q3 / 2016	<b>35,4</b>	0,0	0,0	35,4	0,0	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	<b>35,4</b>
	Q3 / 2015	<b>38,1</b>	0,0	0,0	38,1	0,0	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	<b>38,1</b>
Luxemburg	Q3 / 2016	<b>25,0</b>	0,0	0,0	0,0	25,0	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	<b>25,0</b>
	Q3 / 2015	<b>25,0</b>	0,0	0,0	0,0	25,0	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	<b>25,0</b>
Niederlande	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>41,6</b>	41,6	0,0	0,0	0,0	(41,6)	<b>41,6</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>30,4</b>	30,4	0,0	0,0	0,0	(30,4)	<b>30,4</b>
Schweiz	Q3 / 2016	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>2,6</b>	0,0	0,0	0,0	2,6	(2,6)	<b>2,6</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>3,1</b>	0,0	0,0	0,0	3,1	(3,1)	<b>3,1</b>
USA	Q3 / 2016	<b>134,4</b>	134,4	0,0	0,0	0,0	<b>559,2</b>	445,0	0,0	0,0	114,2	(445,0)	<b>693,6</b>
	Q3 / 2015	<b>0,0</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>522,6</b>	500,2	0,0	0,0	22,4	(500,2)	<b>522,6</b>
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>14.857,4</b>	<b>744,4</b>	<b>4.831,8</b>	<b>4.121,6</b>	<b>5.159,6</b>	<b>2.688,3</b>	<b>1.280,9</b>	<b>504,8</b>	<b>568,4</b>	<b>334,2</b>	<b>(1.335,1)</b>	<b>17.545,7</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>16.518,2</b>	<b>640,0</b>	<b>5.607,3</b>	<b>4.176,8</b>	<b>6.094,1</b>	<b>2.648,6</b>	<b>1.330,3</b>	<b>556,4</b>	<b>544,3</b>	<b>217,6</b>	<b>(1.302,1)</b>	<b>19.166,8</b>

## 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 / 2016	50,8	0,0	0,0	0,0	(50,8)	55,2	0,0	0,0	0,0	(55,2)
	Q3 / 2015	20,9	0,0	0,0	0,0	(20,9)	75,7	0,0	0,0	0,0	(75,7)
Belgien	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Dänemark	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Finnland	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Frankreich	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Großbritannien	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Kanada	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Lettland	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Luxemburg	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Niederlande	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Schweiz	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	3,8	(3,8)	0,0	0,0	0,0	2,6	(2,6)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,3	(0,3)	0,0	0,0	0,0	3,1	(3,1)
USA	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>50,8</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>3,8</b>	<b>(54,6)</b>	<b>55,2</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>2,6</b>	<b>(57,8)</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>20,9</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,3</b>	<b>(21,2)</b>	<b>75,7</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>3,1</b>	<b>(78,8)</b>

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

# Inhalt

Angaben zu Hypothekendarfandbriefen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darfandbriefen und deren Deckungswerten	12
<b>Angaben zu Schiffsdarfandbriefen und deren Deckungswerten</b>	<b>20</b>
Angaben zu Flugzeugdarfandbriefen 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 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015
Pfandbriefumlauf	80,0	80,0	80,8	81,0	78,2	76,5	80,6	81,3	78,2	81,0
Deckungsmasse	211,2	206,5	235,2	228,4	232,2	225,5	236,1	229,5	195,3	192,5
Überdeckung	131,2	126,5	154,4	147,4	154,0	149,0	155,5	148,2	117,1	111,5
Überdeckung in %	164,0	158,1	191,1	182,0	196,9	194,8	192,9	182,3	149,7	137,7

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2016	Q3 / 2015
USD	220,9	213,7

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 / 2016	0,0	0,0	0,0	6,0	6,0
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	6,0	6,0

## Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>80,0</b>	<b>80,0</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	62,50	62,50
Anteil Derivate	0,0	0,0
<b>Deckungsmasse</b>	<b>211,2</b>	<b>206,5</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	2,84	2,91
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	0,0	0,0

## Laufzeitstruktur der Schiffspfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2016		Q3 / 2015	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	0,0	15,2	0,0	27,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	50,0	13,6	0,0	15,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	13,1	0,0	14,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	30,0	13,1	50,0	10,8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,0	49,8	30,0	20,8
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,0	17,1	0,0	45,1
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	25,9	0,0	14,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	62,5	0,0	58,3
mehr als 10 Jahre	0,0	0,9	0,0	0,0
<b>Gesamt</b>	<b>80,0</b>	<b>211,2</b>	<b>80,0</b>	<b>206,5</b>

## Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
bis zu 500 Tsd €	0,0	0,2
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	33,8	26,5
mehr als 5 Mio €	171,4	173,8
<b>Gesamt</b>	<b>205,2</b>	<b>200,5</b>



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

in Mio €		Seeschiffe						Binnenschiffe	Gesamt
		Gesamt	davon						
			Bulker	Containerschiff	Mehrzweckfrachter	Tanker	Sonstige		
Deutschland	Q3 / 2016	150,4	14,5	44,0	8,7	57,6	25,6	0,0	<b>150,4</b>
	Q3 / 2015	148,1	30,6	42,1	4,7	36,7	34,0	0,0	<b>148,1</b>
Malta	Q3 / 2016	15,3	15,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>15,3</b>
	Q3 / 2015	29,3	29,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>29,3</b>
Marshall-Inseln	Q3 / 2016	21,0	0,0	0,0	0,0	21,0	0,0	0,0	<b>21,0</b>
	Q3 / 2015	22,3	0,0	0,0	0,0	22,3	0,0	0,0	<b>22,3</b>
Zypern	Q3 / 2016	18,5	18,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>18,5</b>
	Q3 / 2015	0,8	0,0	0,0	0,8	0,0	0,0	0,0	<b>0,8</b>
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>205,2</b>	<b>48,3</b>	<b>44,0</b>	<b>8,7</b>	<b>78,6</b>	<b>25,6</b>	<b>0,0</b>	<b>205,2</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>200,5</b>	<b>59,9</b>	<b>42,1</b>	<b>5,5</b>	<b>59,0</b>	<b>34,0</b>	<b>0,0</b>	<b>200,5</b>

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	2,6	0,2
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	1,4	0,8

\* 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
<b>Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten</b>	<b>28</b>

## 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 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015	Q3 / 2016	Q3 / 2015
Pfandbriefumlauf	1.006,0	1.006,0	1.034,6	1.040,6	994,8	977,1	1.031,4	1.045,3	994,8	977,1
Deckungsmasse	1.421,2	1.376,3	1.555,6	1.511,1	1.485,8	1.445,9	1.584,4	1.545,3	1.309,0	1.231,0
Überdeckung	415,2	370,3	521,0	470,5	491,0	468,8	553,0	500,0	314,2	253,9
Überdeckung in %	41,3	36,8	50,4	45,2	49,4	48,0	53,6	47,8	31,6	26,0

\* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2016	Q3 / 2015
GBP	22,8	65,6
USD	1.048,2	1.253,4

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 / 2016	0,0	0,0	0,0	235,6	235,6
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	35,0	35,0

## Flugzeugpfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
<b>Pfandbriefumlauf</b>	<b>1.006,0</b>	<b>1.006,0</b>
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	100,00	100,00
Anteil Derivate	0,0	0,0
<b>Deckungsmasse</b>	<b>1.421,2</b>	<b>1.376,3</b>
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	61,58	61,23
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26f Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26f Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	0,0	0,0

## Laufzeitstruktur der Flugzeugpfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2016		Q3 / 2015	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	0,0	184,6	0,0	125,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	501,0	134,2	0,0	136,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	107,1	0,0	107,3
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	163,5	501,0	91,7
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	500,0	153,4	0,0	304,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	5,0	247,1	500,0	157,5
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	114,6	5,0	160,9
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	252,2	0,0	286,5
mehr als 10 Jahre	0,0	64,5	0,0	7,3
<b>Gesamt</b>	<b>1.006,0</b>	<b>1.421,2</b>	<b>1.006,0</b>	<b>1.376,3</b>

## Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2016	Q3 / 2015
bis zu 500 Tsd €	0,8	1,0
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	69,9	91,1
mehr als 5 Mio €	1.114,9	1.249,2
<b>Gesamt</b>	<b>1.185,6</b>	<b>1.341,3</b>



## Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach Flugzeugtypen

in Mio €		Business Jet	Freighter	Narrowbody	Regional Jet	Turboprop	Ultralarge	Widebody	Gesamt
Deutschland	Q3 / 2016	0,0	123,9	55,8	0,0	20,3	0,0	0,0	<b>200,0</b>
	Q3 / 2015	0,0	133,3	137,6	0,0	23,1	0,0	0,0	<b>294,0</b>
Finnland	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	40,7	<b>40,7</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	44,8	<b>44,8</b>
Frankreich	Q3 / 2016	0,0	0,0	15,3	0,0	0,0	59,2	58,3	<b>132,8</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	16,3	0,0	0,0	49,2	70,8	<b>136,3</b>
Großbritannien	Q3 / 2016	0,0	0,0	31,7	9,6	24,8	80,4	0,0	<b>146,5</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	74,2	12,0	40,0	99,2	0,0	<b>225,4</b>
Irland	Q3 / 2016	0,0	0,0	55,9	0,0	0,0	0,0	44,0	<b>99,9</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	70,2	0,0	0,0	0,0	48,4	<b>118,6</b>
Luxemburg	Q3 / 2016	0,0	57,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>57,0</b>
	Q3 / 2015	0,0	12,6	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>12,6</b>
Norwegen	Q3 / 2016	0,0	0,0	6,2	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>6,2</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	38,8	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>38,8</b>
Schweiz	Q3 / 2016	0,0	0,0	20,2	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>20,2</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	<b>0,0</b>
USA	Q3 / 2016	0,0	107,4	341,1	33,8	0,0	0,0	0,0	<b>482,3</b>
	Q3 / 2015	0,0	0,0	361,7	88,9	0,0	0,0	20,2	<b>470,8</b>
<b>Gesamt</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>0,0</b>	<b>288,3</b>	<b>526,2</b>	<b>43,4</b>	<b>45,1</b>	<b>139,6</b>	<b>143,0</b>	<b>1.185,6</b>
	<b>Q3 / 2015</b>	<b>0,0</b>	<b>145,9</b>	<b>698,8</b>	<b>100,9</b>	<b>63,1</b>	<b>148,4</b>	<b>184,2</b>	<b>1.341,3</b>

## Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

<b>in Mio €</b>	<b>Q3 / 2016</b>	<b>Q3 / 2015</b>
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	0,0	0,0