



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 30. September 2017

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 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	2.694,7	1.905,6	2.770,1	1.947,8	2.627,8	1.882,7	2.806,6	1.945,0	2.627,8	1.882,7
Deckungsmasse	5.265,6	3.285,0	5.742,2	3.648,9	5.314,2	3.370,9	5.819,8	3.644,4	5.314,1	3.354,4
Überdeckung	2.570,9	1.379,4	2.972,1	1.701,1	2.686,4	1.488,2	3.013,2	1.699,4	2.686,3	1.471,7
Überdeckung in %	95,4	72,4	107,3	87,3	102,2	79,0	107,4	87,4	102,2	78,2

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2017	Q3 / 2016
USD	0,8	98,9

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 / 2017	0,0	0,0	0,0	95,0	95,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	75,0	75,0

Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	2.694,7	1.905,6
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	36,75	18,76
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	5.265,6	3.285,0
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	76,80	80,15
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	7,1	7,3
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q3 / 2017		Q3 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	110,0	637,1	70,0	560,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	32,0	276,9	0,0	153,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	575,1	306,2	70,0	238,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	595,7	300,9	0,0	175,7
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	566,0	514,9	918,1	421,8
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	171,8	548,8	500,0	253,8
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	115,0	424,8	75,0	285,8
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	407,0	1.948,5	272,5	1.111,1
mehr als 10 Jahre	122,1	307,5	0,0	84,4
Gesamt	2.694,7	5.265,6	1.905,6	3.285,0

Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
bis zu 300 Tsd €	1.380,4	1.088,0
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	564,4	299,9
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	2.003,1	1.021,0
mehr als 10 Mio €	1.222,7	801,1
Gesamt	5.170,6	3.210,0

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 / 2017	248,2	894,6	2.415,9	0,0	0,8	3.559,5
	Q3 / 2016	184,1	714,2	1.447,8	0,0	0,5	2.346,6
Luxemburg	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Österreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
USA	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Gesamt	Q3 / 2017	248,2	894,6	2.415,9	0,0	0,8	3.559,5
	Q3 / 2016	184,1	714,2	1.447,8	0,0	0,5	2.346,6

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 / 2017	370,0	342,7	72,1	684,9	0,0	0,5	1.470,2
	Q3 / 2016	251,3	155,3	4,6	204,0	0,0	0,0	615,2
Luxemburg	Q3 / 2017	140,9	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	140,9
	Q3 / 2016	143,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	143,5
Österreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	7,9	0,0	0,0	0,0	0,0	7,9
USA	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	96,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	96,8
Gesamt	Q3 / 2017	510,9	342,7	72,1	684,9	0,0	0,5	1.611,1
	Q3 / 2016	491,6	163,2	4,6	204,0	0,0	0,0	863,4

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 / 2017	0,0	0,2
	Q3 / 2016	0,0	0,1
Luxemburg	Q3 / 2017	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0
Österreich	Q3 / 2017	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0
USA	Q3 / 2017	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0
Gesamt	Q3 / 2017	0,0	0,2
	Q3 / 2016	0,0	0,1

* 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 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	16.941,3	13.361,9	19.284,2	16.228,2	16.890,6	14.190,7	20.288,2	16.527,2	17.243,5	14.577,6
Deckungsmasse	19.155,2	18.153,8	21.519,4	21.353,7	18.896,3	18.884,1	22.677,6	21.706,7	18.982,2	19.017,7
Überdeckung	2.213,9	4.791,9	2.235,2	5.125,5	2.005,7	4.693,4	2.389,4	5.179,5	1.738,7	4.440,1
Überdeckung in %	13,1	35,9	11,6	31,6	11,9	33,1	11,8	31,3	10,1	30,5

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2017	Q3 / 2016
CHF	0,0	2,9
JPY	0,0	-71,9
USD	-1.075,4	-944,9

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 / 2017	0,0	512,2	185,0	512,2
	Q3 / 2016	0,0	608,1	70,0	608,1

Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	16.941,3	13.361,9
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	92,68	92,00
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	19.155,2	18.153,8
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	84,84	83,40
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 / 2017		Q3 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	1.087,1	1.480,7	364,8	1.499,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	656,3	968,6	604,5	1.363,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	3.127,5	922,7	947,9	1.001,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	461,3	820,8	425,8	827,9
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.219,8	1.842,4	3.382,0	1.540,5
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.570,7	1.350,7	937,0	1.776,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	370,2	1.839,7	1.411,1	1.161,6
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	4.238,6	5.394,6	1.722,2	4.873,1
mehr als 10 Jahre	4.209,8	4.535,0	3.566,6	4.110,0
Gesamt	16.941,3	19.155,2	13.361,9	18.153,8

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
bis zu 10 Mio €	2.922,1	1.809,4
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	6.450,9	5.026,6
mehr als 100 Mio €	9.270,0	10.709,7
Gesamt	18.643,0	17.545,7

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 / 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
	Q3 / 2016	14.632,6	610,0	4.831,8	4.086,2	5.104,6	1.787,6	650,9	504,8	568,4	63,5	(582,7)	16.420,2
Belgien	Q3 / 2017	30,0	0,0	0,0	0,0	30,0	21,0	0,0	0,0	0,0	21,0	(21,0)	51,0
	Q3 / 2016	30,0	0,0	0,0	0,0	30,0	24,9	0,0	0,0	0,0	24,9	(24,9)	54,9
Dänemark	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	69,0	0,0	0,0	0,0	69,0	(69,0)	69,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	73,0	0,0	0,0	0,0	73,0	(73,0)	73,0
Finnland	Q3 / 2017	5,0	0,0	0,0	0,0	5,0	41,7	0,0	0,0	0,0	41,7	(41,7)	46,7
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	56,0	0,0	0,0	0,0	56,0	(56,0)	56,0
Frankreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	111,6	111,6	0,0	0,0	0,0	(26,4)	111,6
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	64,5	64,5	0,0	0,0	0,0	(64,5)	64,5
Großbritannien	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	34,7	34,7	0,0	0,0	0,0	(34,7)	34,7
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	44,8	44,8	0,0	0,0	0,0	(44,8)	44,8
Kanada	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	24,0	24,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	24,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	34,1	34,1	0,0	0,0	0,0	(0,0)	34,1
Lettland	Q3 / 2017	32,5	0,0	0,0	32,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	32,5
	Q3 / 2016	35,4	0,0	0,0	35,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	35,4
Luxemburg	Q3 / 2017	35,0	0,0	0,0	0,0	35,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	35,0
	Q3 / 2016	25,0	0,0	0,0	0,0	25,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	25,0
Niederlande	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	46,9	46,9	0,0	0,0	0,0	(46,9)	46,9
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	41,6	41,6	0,0	0,0	0,0	(41,6)	41,6
Österreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	151,8	151,8	0,0	0,0	0,0	(41,3)	151,8
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0
Schweiz	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	6,0	0,0	0,0	0,0	6,0	(6,0)	6,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	2,6	0,0	0,0	0,0	2,6	(2,6)	2,6
USA	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	508,3	388,8	0,0	0,0	119,5	(388,8)	508,3
	Q3 / 2016	134,4	134,4	0,0	0,0	0,0	559,2	445,0	0,0	0,0	114,2	(445,0)	693,6
Gesamt	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
	Q3 / 2016	14.857,4	744,4	4.831,8	4.121,6	5.159,6	2.688,3	1.280,9	504,8	568,4	334,2	(1.335,1)	17.545,7

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 / 2017	60,7	0,0	0,0	0,0	(60,7)	28,9	0,0	0,0	0,0	(28,9)
	Q3 / 2016	50,8	0,0	0,0	0,0	(50,8)	55,2	0,0	0,0	0,0	(55,2)
Belgien	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Dänemark	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Finnland	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Frankreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Großbritannien	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Kanada	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Lettland	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Luxemburg	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Niederlande	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Österreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Schweiz	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	3,8	(3,8)	0,0	0,0	0,0	2,6	(2,6)
USA	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Gesamt	Q3 / 2017	60,7	0,0	0,0	0,0	(60,7)	28,9	0,0	0,0	0,0	(28,9)
	Q3 / 2016	50,8	0,0	0,0	3,8	(54,6)	55,2	0,0	0,0	2,6	(57,8)

* 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
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 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	106,1	80,0	111,7	80,8	107,6	78,2	111,7	80,6	107,6	78,2
Deckungsmasse	392,4	211,2	421,6	235,2	414,9	232,2	423,9	236,1	363,0	195,3
Überdeckung	286,3	131,2	309,9	154,4	307,3	154,0	312,2	155,5	255,4	117,1
Überdeckung in %	269,8	164,0	277,4	191,1	285,6	196,9	279,5	192,9	237,4	149,7

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2017	Q3 / 2016
USD	311,1	220,9

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 / 2017	0,0	0,0	0,0	92,8	92,8
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	6,0	6,0

Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	106,1	80,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	62,30	62,50
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	392,4	211,2
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	18,56	2,84
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 / 2017		Q3 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	30,0	22,3	0,0	15,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	33,0	66,5	50,0	13,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	47,3	0,0	13,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	32,9	30,0	13,1
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	10,0	69,4	0,0	49,8
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	2,6	56,0	0,0	17,1
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	30,5	36,5	0,0	25,9
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	59,1	0,0	62,5
mehr als 10 Jahre	0,0	2,4	0,0	0,9
Gesamt	106,1	392,4	80,0	211,2

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
bis zu 500 Tsd €	1,0	0,0
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	124,7	33,8
mehr als 5 Mio €	173,9	171,4
Gesamt	299,6	205,2

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 / 2017	175,7	2,9	38,8	51,9	65,6	16,5	0,0	175,7
	Q3 / 2016	150,4	14,5	44,0	8,7	57,6	25,6	0,0	150,4
Antigua und Barbuda	Q3 / 2017	3,2	0,0	0,0	0,0	0,0	3,2	0,0	3,2
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Gibraltar	Q3 / 2017	0,3	0,0	0,0	0,0	0,3	0,0	0,0	0,3
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Großbritannien	Q3 / 2017	28,8	0,0	0,0	0,0	0,0	28,8	0,0	28,8
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kroatien	Q3 / 2017	23,5	0,0	0,0	0,0	23,5	0,0	0,0	23,5
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Liberia	Q3 / 2017	2,7	0,0	2,2	0,0	0,5	0,0	0,0	2,7
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Malta	Q3 / 2017	30,9	13,6	0,0	0,0	17,3	0,0	0,0	30,9
	Q3 / 2016	15,3	15,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	15,3
Marshall-Inseln	Q3 / 2017	34,5	6,5	0,0	0,0	28,0	0,0	0,0	34,5
	Q3 / 2016	21,0	0,0	0,0	0,0	21,0	0,0	0,0	21,0
Zypern	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	18,5	18,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	18,5
Gesamt	Q3 / 2017	299,6	23,0	41,0	51,9	135,2	48,5	0,0	299,6
	Q3 / 2016	205,2	48,3	44,0	8,7	78,6	25,6	0,0	205,2

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	1,2	2,6
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	7,9	1,4

* 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 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	505,0	1.006,0	518,0	1.034,6	500,5	994,8	516,5	1.031,4	500,5	994,8
Deckungsmasse	949,0	1.421,2	1.031,3	1.555,6	987,5	1.485,8	1.064,0	1.584,4	852,2	1.309,0
Überdeckung	444,0	415,2	513,3	521,0	487,0	491,0	547,5	553,0	351,7	314,2
Überdeckung in %	87,9	41,3	99,1	50,4	97,3	49,4	106,0	53,6	70,3	31,6

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q3 / 2017	Q3 / 2016
GBP	18,1	22,8
USD	801,8	1.048,2

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 / 2017	0,0	0,0	0,0	40,0	40,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	235,6	235,6

Flugzeugpfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
Pfandbriefumlauf	505,0	1.006,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	100,00	100,00
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	949,0	1.421,2
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	54,04	61,58
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 / 2017		Q3 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	0,0	99,3	0,0	184,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	0,0	117,2	501,0	134,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	500,0	102,4	0,0	107,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	64,7	0,0	163,5
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	5,0	164,3	500,0	153,4
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,0	109,4	5,0	247,1
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	71,5	0,0	114,6
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	179,9	0,0	252,2
mehr als 10 Jahre	0,0	40,3	0,0	64,5
Gesamt	505,0	949,0	1.006,0	1.421,2

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
bis zu 500 Tsd €	0,4	0,8
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	93,2	69,9
mehr als 5 Mio €	815,4	1.114,9
Gesamt	909,0	1.185,6

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach Flugzeugtypen

in Mio €		Business Jet	Freighter	Narrowbody	Regional Jet	Turboprop	Ultralarge	Widebody	Gesamt
Deutschland	Q3 / 2017	0,0	107,8	31,8	0,0	16,4	0,0	0,0	156,0
	Q3 / 2016	0,0	123,9	55,8	0,0	20,3	0,0	0,0	200,0
Finnland	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	34,4	34,4
	Q3 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	40,7	40,7
Frankreich	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	62,5	31,7	94,2
	Q3 / 2016	0,0	0,0	15,3	0,0	0,0	59,2	58,3	132,8
Großbritannien	Q3 / 2017	0,0	0,0	18,8	8,0	33,2	36,4	0,0	96,4
	Q3 / 2016	0,0	0,0	31,7	9,6	24,8	80,4	0,0	146,5
Irland	Q3 / 2017	0,0	0,0	48,2	0,0	0,0	0,0	36,3	84,5
	Q3 / 2016	0,0	0,0	55,9	0,0	0,0	0,0	44,0	99,9
Luxemburg	Q3 / 2017	0,0	4,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	4,8
	Q3 / 2016	0,0	57,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	57,0
Norwegen	Q3 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q3 / 2016	0,0	0,0	6,2	0,0	0,0	0,0	0,0	6,2
Schweiz	Q3 / 2017	0,0	0,0	28,5	0,0	0,0	0,0	0,0	28,5
	Q3 / 2016	0,0	0,0	20,2	0,0	0,0	0,0	0,0	20,2
USA	Q3 / 2017	0,0	93,0	258,5	58,7	0,0	0,0	0,0	410,2
	Q3 / 2016	0,0	107,4	341,1	33,8	0,0	0,0	0,0	482,3
Gesamt	Q3 / 2017	0,0	205,6	385,8	66,7	49,6	98,9	102,4	909,0
	Q3 / 2016	0,0	288,3	526,2	43,4	45,1	139,6	143,0	1.185,6

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q3 / 2017	Q3 / 2016
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