



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 31. Dezember 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	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	3.110,8	1.835,6	3.186,7	1.868,6	3.045,0	1.807,9	3.218,7	1.873,1	3.045,0	1.807,9
Deckungsmasse	5.164,1	3.579,6	5.609,7	3.947,3	5.194,8	3.649,5	5.683,2	3.978,5	5.194,6	3.632,1
Überdeckung	2.053,3	1.744,0	2.423,0	2.078,7	2.149,8	1.841,6	2.464,5	2.105,4	2.149,6	1.824,2
Überdeckung in %	66,0	95,0	76,0	111,2	70,6	101,9	76,6	112,4	70,6	100,9

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016
USD	0,8	104,3

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	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	95,0	95,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	115,0	115,0

Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	3.110,8	1.835,6
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	31,29	19,48
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	5.164,1	3.579,6
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	77,39	76,98
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	7,0
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q4 / 2017		Q4 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	52,0	656,7	0,0	521,1
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	121,8	266,6	70,0	178,1
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	1.022,0	333,7	0,0	297,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	136,0	261,9	70,0	129,2
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	682,0	555,5	848,1	444,2
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	209,3	516,5	575,0	291,3
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	103,5	498,0	50,0	310,8
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	662,1	1.822,9	222,5	1.250,3
mehr als 10 Jahre	122,1	252,3	0,0	157,5
Gesamt	3.110,8	5.164,1	1.835,6	3.579,6

Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
bis zu 300 Tsd €	1.354,9	1.084,2
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	559,9	315,0
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	2.015,7	1.122,5
mehr als 10 Mio €	1.138,6	942,9
Gesamt	5.069,1	3.464,6

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	Q4 / 2017	243,5	875,6	2.368,1	0,0	0,8	3.488,0
	Q4 / 2016	184,1	713,7	1.694,4	0,0	0,7	2.592,9
Luxemburg	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Österreich	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
USA	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Gesamt	Q4 / 2017	243,5	875,6	2.368,1	0,0	0,8	3.488,0
	Q4 / 2016	184,1	713,7	1.694,4	0,0	0,7	2.592,9

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	Q4 / 2017	368,5	353,9	71,8	681,8	0,0	0,5	1.476,5
	Q4 / 2016	256,5	161,1	5,9	200,5	0,0	0,0	624,0
Luxemburg	Q4 / 2017	104,6	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	104,6
	Q4 / 2016	137,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	137,5
Österreich	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	7,8	0,0	0,0	0,0	0,0	7,8
USA	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	102,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	102,4
Gesamt	Q4 / 2017	473,1	353,9	71,8	681,8	0,0	0,5	1.581,1
	Q4 / 2016	496,4	168,9	5,9	200,5	0,0	0,0	871,7

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
Deutschland	Q4 / 2017	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,1
Luxemburg	Q4 / 2017	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0
Österreich	Q4 / 2017	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0
USA	Q4 / 2017	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0
Gesamt	Q4 / 2017	0,0	0,0
	Q4 / 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	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	16.672,0	14.068,1	19.007,6	16.462,2	16.610,1	14.455,6	19.936,4	17.059,6	16.822,9	14.846,7
Deckungsmasse	18.005,8	18.060,5	20.380,4	20.825,9	17.869,8	18.480,5	21.425,4	21.552,0	17.949,9	18.599,8
Überdeckung	1.333,8	3.992,4	1.372,8	4.363,7	1.259,7	4.024,9	1.489,0	4.492,4	1.127,0	3.753,1
Überdeckung in %	8,0	28,4	7,2	26,5	7,6	27,8	7,5	26,3	6,7	25,3

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016
CHF	0,0	2,9
USD	-536,4	-1.116,2

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	Q4 / 2017	0,0	508,2	185,0	508,2
	Q4 / 2016	0,0	513,0	95,0	513,0

Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	16.672,0	14.068,1
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	93,95	92,82
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	18.005,8	18.060,5
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	86,34	83,04
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 €	Q4 / 2017		Q4 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	637,0	1.055,9	698,1	1.786,2
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.098,5	1.130,7	947,1	1.091,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	2.605,0	911,2	296,1	850,7
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	872,5	933,6	1.019,7	889,9
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	777,2	1.619,0	3.284,6	1.888,8
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.416,1	1.185,3	499,2	1.402,7
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	473,4	1.374,7	1.316,8	1.286,7
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	4.690,6	5.322,5	2.688,2	4.979,4
mehr als 10 Jahre	4.101,7	4.472,9	3.318,3	3.884,5
Gesamt	16.672,0	18.005,8	14.068,1	18.060,5

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
bis zu 10 Mio €	2.941,6	1.833,8
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	6.335,2	4.843,2
mehr als 100 Mio €	8.220,8	10.870,5
Gesamt	17.497,6	17.547,5

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	Q4 / 2017	14.306,1	125,0	3.527,7	6.160,3	4.493,1	2.113,2	626,4	547,4	686,0	253,4	(557,9)	16.419,3
	Q4 / 2016	14.809,2	610,0	5.112,2	4.078,7	5.008,3	1.741,4	687,6	424,2	566,7	62,9	(619,6)	16.550,6
Belgien	Q4 / 2017	30,0	0,0	0,0	0,0	30,0	30,2	0,0	0,0	0,0	30,2	(30,2)	60,2
	Q4 / 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	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	65,9	0,0	0,0	0,0	65,9	(65,9)	65,9
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	72,6	0,0	0,0	0,0	72,6	(72,6)	72,6
Finnland	Q4 / 2017	5,0	0,0	0,0	0,0	5,0	27,5	0,0	0,0	0,0	27,5	(27,5)	32,5
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	53,5	0,0	0,0	0,0	53,5	(53,5)	53,5
Frankreich	Q4 / 2017	52,1	0,0	0,0	0,0	52,1	158,9	158,9	0,0	0,0	0,0	(19,8)	211,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	45,6	45,6	0,0	0,0	0,0	(45,6)	45,6
Großbritannien	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	32,2	32,2	0,0	0,0	0,0	(32,2)	32,2
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	45,3	45,3	0,0	0,0	0,0	(45,3)	45,3
Kanada	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	20,1	20,1	0,0	0,0	0,0	(0,0)	20,1
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	32,3	32,3	0,0	0,0	0,0	(0,0)	32,3
Lettland	Q4 / 2017	31,8	0,0	0,0	31,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	31,8
	Q4 / 2016	34,6	0,0	0,0	34,6	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	34,6
Luxemburg	Q4 / 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
	Q4 / 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	Q4 / 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
	Q4 / 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	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	38,7	38,7	0,0	0,0	0,0	(38,7)	38,7
	Q4 / 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	Q4 / 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
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	24,7	0,0	0,0	0,0	24,7	(24,7)	24,7
USA	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	498,0	374,6	0,0	0,0	123,4	(374,6)	498,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	566,8	431,1	0,0	0,0	135,7	(431,1)	566,8
Gesamt	Q4 / 2017	14.460,0	125,0	3.527,7	6.192,1	4.615,2	3.037,6	1.297,8	547,4	686,0	506,4	(1.199,7)	17.497,6
	Q4 / 2016	14.898,8	610,0	5.112,2	4.113,3	5.063,3	2.648,7	1.283,5	424,2	566,7	374,3	(1.358,9)	17.547,5

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				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Deutschland	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	50,8	0,0	0,0	0,0	(50,8)	55,2	0,0	0,0	0,0	(55,2)
Belgien	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Dänemark	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Finnland	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Frankreich	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Großbritannien	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Kanada	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Lettland	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Luxemburg	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Niederlande	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Österreich	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Schweiz	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	3,8	(3,8)	0,0	0,0	0,0	2,6	(2,6)
USA	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Gesamt	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q4 / 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	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	96,1	80,0	101,5	80,8	97,9	78,7	101,5	80,6	97,9	78,7
Deckungsmasse	321,0	297,8	348,2	330,8	344,3	327,3	350,2	332,8	294,4	274,5
Überdeckung	224,9	217,8	246,7	250,0	246,4	248,6	248,7	252,2	196,5	195,8
Überdeckung in %	234,0	272,3	243,1	309,4	251,7	315,9	245,0	312,9	200,7	248,8

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016
USD	299,4	316,3

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	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	26,0	26,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	6,0	6,0

Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	96,1	80,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	58,38	62,50
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	321,0	297,8
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	3,74	2,01
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 €	Q4 / 2017		Q4 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	20,0	37,0	0,0	19,6
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	33,0	37,9	50,0	19,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	35,4	0,0	18,9
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	20,5	30,0	32,1
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	10,0	63,6	0,0	45,9
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	2,6	57,2	0,0	30,9
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	30,5	34,7	0,0	56,1
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	33,0	0,0	70,2
mehr als 10 Jahre	0,0	1,7	0,0	5,1
Gesamt	96,1	321,0	80,0	297,8

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
bis zu 500 Tsd €	1,4	0,4
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	112,8	47,1
mehr als 5 Mio €	180,8	244,3
Gesamt	295,0	291,8

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	Q4 / 2017	170,6	10,6	33,3	49,2	62,2	15,3	0,0	170,6
	Q4 / 2016	152,1	14,8	37,7	8,6	69,4	21,6	0,0	152,1
Antigua und Barbuda	Q4 / 2017	3,0	0,0	0,0	0,0	0,0	3,0	0,0	3,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Großbritannien	Q4 / 2017	27,7	0,0	0,0	0,0	0,0	27,7	0,0	27,7
	Q4 / 2016	34,6	0,0	0,0	0,0	0,0	34,6	0,0	34,6
Kroatien	Q4 / 2017	22,7	0,0	0,0	0,0	22,7	0,0	0,0	22,7
	Q4 / 2016	27,4	0,0	0,0	0,0	27,4	0,0	0,0	27,4
Liberia	Q4 / 2017	2,5	0,0	2,1	0,0	0,4	0,0	0,0	2,5
	Q4 / 2016	9,0	0,0	2,7	0,0	6,3	0,0	0,0	9,0
Malta	Q4 / 2017	29,5	13,4	0,0	0,0	16,1	0,0	0,0	29,5
	Q4 / 2016	16,2	16,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	16,2
Marshall-Inseln	Q4 / 2017	33,0	6,0	0,0	0,0	27,0	0,0	0,0	33,0
	Q4 / 2016	33,3	0,0	0,0	0,0	33,3	0,0	0,0	33,3
Schweden	Q4 / 2017	6,0	0,0	0,0	0,0	0,0	6,0	0,0	6,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Zypern	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	19,2	19,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	19,2
Gesamt	Q4 / 2017	295,0	30,0	35,4	49,2	128,4	52,0	0,0	295,0
	Q4 / 2016	291,8	50,2	40,4	8,6	136,4	56,2	0,0	291,8

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	2,3	0,0
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	13,9	0,0

* 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	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	505,0	1.006,0	517,8	1.033,3	503,5	999,8	516,4	1.031,3	503,5	999,8
Deckungsmasse	891,2	1.478,5	967,2	1.589,7	921,1	1.522,9	1.003,4	1.632,8	800,9	1.342,6
Überdeckung	386,2	472,5	449,4	556,4	417,6	523,1	487,0	601,5	297,4	342,8
Überdeckung in %	76,5	47,0	86,8	53,8	82,9	52,3	94,3	58,3	59,1	34,3

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q4 / 2017	Q4 / 2016
GBP	16,9	21,9
USD	712,0	1.069,6

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	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	40,0	40,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	235,6	235,6

Flugzeugpfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
Pfandbriefumlauf	505,0	1.006,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	100,00	100,00
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	891,2	1.478,5
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	55,00	61,53
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 €	Q4 / 2017		Q4 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	0,0	80,6	0,0	332,7
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	0,0	81,8	501,0	102,4
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	500,0	88,4	0,0	92,1
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	5,0	65,2	0,0	181,7
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,0	199,5	505,0	136,3
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,0	70,2	0,0	291,3
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	75,0	0,0	65,4
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	196,0	0,0	239,0
mehr als 10 Jahre	0,0	34,5	0,0	37,6
Gesamt	505,0	891,2	1.006,0	1.478,5

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 2016
bis zu 500 Tsd €	0,0	0,9
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	91,8	72,1
mehr als 5 Mio €	759,4	1.169,9
Gesamt	851,2	1.242,9

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach Flugzeugtypen

in Mio €		Business Jet	Freighter	Narrowbody	Regional Jet	Turboprop	Ultralarge	Widebody	Gesamt
Deutschland	Q4 / 2017	0,0	103,9	29,1	0,0	15,5	0,0	0,0	148,5
	Q4 / 2016	0,0	128,6	56,2	0,0	20,7	0,0	0,0	205,5
Finnland	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	32,9	32,9
	Q4 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	42,0	42,0
Frankreich	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	59,1	30,5	89,6
	Q4 / 2016	0,0	0,0	15,9	0,0	0,0	72,8	37,7	126,4
Großbritannien	Q4 / 2017	0,0	0,0	20,6	7,6	31,2	35,0	0,0	94,4
	Q4 / 2016	0,0	0,0	32,8	9,2	40,8	77,7	0,0	160,5
Irland	Q4 / 2017	0,0	0,0	2,2	0,0	0,0	0,0	34,6	36,8
	Q4 / 2016	0,0	0,0	57,7	0,0	0,0	0,0	45,3	103,0
Luxemburg	Q4 / 2017	0,0	4,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	4,1
	Q4 / 2016	0,0	57,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	57,1
Norwegen	Q4 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q4 / 2016	0,0	0,0	6,3	0,0	0,0	0,0	0,0	6,3
Schweiz	Q4 / 2017	0,0	0,0	27,2	0,0	0,0	0,0	0,0	27,2
	Q4 / 2016	0,0	0,0	33,8	0,0	0,0	0,0	0,0	33,8
USA	Q4 / 2017	0,0	89,4	272,3	56,0	0,0	0,0	0,0	417,7
	Q4 / 2016	0,0	111,3	366,6	30,4	0,0	0,0	0,0	508,3
Gesamt	Q4 / 2017	0,0	197,4	351,4	63,6	46,7	94,1	98,0	851,2
	Q4 / 2016	0,0	297,0	569,3	39,6	61,5	150,5	125,0	1.242,9

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q4 / 2017	Q4 / 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