

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio €	30.09.2011			30.09.2010		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	4.062,7	4.450,6	4.622,2	4.570,2	4.953,3	5.132,1
<i>(davon Pfandbriefumlauf)</i>	<i>(3.931,6)</i>	<i>(4.262,3)</i>	<i>(4.437,1)</i>	<i>4.570,2</i>	<i>4.934,6</i>	<i>5.113,6</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(131,1)</i>	<i>(188,3)</i>	<i>(185,1)</i>		<i>(18,8)</i>	<i>(18,5)</i>
Deckungswerte	5.493,9	5.859,9	5.877,5	5.916,8	6.264,6	6.283,1
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(5.373,1)</i>	<i>(5.689,6)</i>	<i>(5.703,5)</i>	<i>(5.299,2)</i>	<i>(5.605,2)</i>	<i>(5.610,6)</i>
<i>davon weitere Deckungswerte (§ 26 PfandBG)</i>						
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(30,0)</i>	<i>(34,9)</i>	<i>(36,0)</i>	<i>(307,0)</i>	<i>(327,1)</i>	<i>(331,7)</i>
Risikobarwert nach Zinsstresstest			1.255,3			1.151,0
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			-138,5			-3,7
Über-/ Unterdeckung	1.431,2	1.409,3	1.116,8	1.346,6	1.311,3	1.147,3
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1.286,7	1.512,0	1.672,9	1.423,5	1.680,0	1.838,5
Deckungswerte	1.513,5	1.681,1	1.790,3	1.613,9	1.826,2	1.937,1
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(928,2)</i>	<i>(1.050,0)</i>	<i>(1.126,6)</i>	<i>(1.156,2)</i>	<i>(1.300,8)</i>	<i>(1.376,6)</i>
<i>(davon weitere Deckungswerte (§ 20 Abs. 2 PfandBG))</i>						
<i>(davon Derivate)</i>	<i>(90,0)</i>	<i>(90,7)</i>	<i>(90,8)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>
Überdeckung	226,8	169,1	117,4	190,4	146,2	98,6

*) ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken

Laufzeitstruktur

Mio €	30.09.2011	30.09.2010
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	432,1	281,1
mehr als einem bis zu zwei Jahren	814,4	626,2
mehr als zwei bis zu drei Jahren	623,0	638,2
mehr als drei bis zu vier Jahren	325,2	614,2
mehr als vier bis zu fünf Jahren	309,5	517,3
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	1.024,8	847,6
mehr als zehn Jahren	402,6	1.045,6
	3.931,6	4.570,2
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	5.354,9	4.665,5
mehr als einem bis zu zwei Jahren	49,5	975,5
mehr als zwei bis zu drei Jahren	47,9	131,1
mehr als drei bis zu vier Jahren	32,3	93,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	4,4	18,9
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	4,9	29,0
mehr als zehn Jahren	0,0	3,5
	5.493,9	5.916,8
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	133,9	21,7
mehr als einem bis zu zwei Jahren	17,4	133,9
mehr als zwei bis zu drei Jahren	14,3	17,4
mehr als drei bis zu vier Jahren	120,1	14,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	54,0	120,1
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	219,5	267,0
mehr als zehn Jahren	727,5	849,1
	1.286,7	1.423,5
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	468,5	442,5
mehr als einem bis zu zwei Jahren	143,0	103,1
mehr als zwei bis zu drei Jahren	157,3	143,0
mehr als drei bis zu vier Jahren	72,2	122,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	92,9	97,2
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	253,0	280,3
mehr als zehn Jahren	326,6	425,5
	1.513,5	1.613,9

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen

Mio €	30.09.2011	30.09.2010
bis zu 500 Tsd €	9,0	10,6
von mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	1.024,7	1.014,5
von mehr als 5 Mio €	4.460,2	4.891,7
	5.493,9	5.916,8

Registerland der beliebten Schiffe und Schiffsbauwerke

Mio €	30.09.2011	30.09.2010
Seeschiffe		
Antigua und Barbuda	16,4	18,1
Bahamas	222,4	250,1
Chile	0,7	3,0
Deutschland	2.156,2	2.247,5
Gibraltar	2,8	19,3
Griechenland	522,1	473,2
Großbritannien	99,5	92,9
Hongkong	243,6	207,3
Insel Man	80,1	51,6
Israel	0,0	0,0
Italien	170,2	163,8
Kaimaninseln	4,1	4,6
Liberia	317,0	322,5
Malta	376,9	267,6
Marshallinseln	487,8	532,4
Niederlande	66,4	66,0
Norwegen	63,6	71,6
Österreich	0,0	0,0
Panama	218,8	198,7
Portugal	0,0	2,6
Singapur	48,7	52,4
Türkei	13,3	15,3
Vanuatu	0,0	3,2
Zypern	262,5	235,5
	5.373,1	5.299,2
Binnenschiffe		
Deutschland	0,0	0,0
Gesamt	5.373,1	5.299,2

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen

Mio €	30.09.2011	30.09.2010
Staaten		
Belgien	25,0	25,0
Griechenland	0,0	0,0
Italien	35,2	84,4
Litauen	0,0	10,0
Polen	40,0	40,0
Spanien	0,0	20,0
Ungarn	20,0	20,0
	120,2	199,4
Regionale Gebietskörperschaften		
Deutschland	672,6	732,6
Spanien	20,0	0,0
	692,6	732,6
Sonstige Schuldner		
mit Sitz in:		
Deutschland	545,7	539,4
Frankreich	5,0	0,0
Griechenland	0,0	27,5
Japan	10,0	10,0
Irland	0,0	25,0
Österreich	130,0	70,0
Slowenien	10,0	10,0
	700,7	681,9
	1.513,5	1.613,9

Rückständige Leistungen

Rückständige Leistungen (*Rückstand mindestens 90 Tage*) lagen wie im Vorjahr nicht vor.