

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio €	31.12.2011			31.12.2010		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	4.103,0	4.467,5	4.622,6	4.559,9	4.828,8	5.009,8
<i>(davon Pfandbriefumlauf)</i>	<i>(3.852,5)</i>	<i>(4.187,1)</i>	<i>(4.345,0)</i>	<i>(4.471,0)</i>	<i>(4.693,2)</i>	<i>(4.876,1)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(250,5)</i>	<i>(280,4)</i>	<i>(277,6)</i>	<i>(88,9)</i>	<i>(135,6)</i>	<i>(133,7)</i>
Deckungswerte	5.895,6	6.263,2	6.281,8	5.727,6	6.082,9	6.108,2
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(5.776,8)</i>	<i>(6.126,9)</i>	<i>(6.143,9)</i>	<i>(5.409,8)</i>	<i>(5.710,7)</i>	<i>(5.728,6)</i>
<i>davon weitere Deckungswerte (§ 26 PfandBG)</i>	<i>(30,0)</i>	<i>(35,3)</i>	<i>(36,4)</i>	<i>(215,0)</i>	<i>(228,0)</i>	<i>(231,5)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(11,3)</i>	<i>(11,6)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(36,7)</i>	<i>(39,8)</i>
Risikobarwert nach Zinsstresstest			1.659,2			1.098,4
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			-218,2			-45,4
Über-/ Unterdeckung	1.792,6	1.795,7	1.441,0	1.167,7	1.254,1	1.053,0
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1.225,2	1.464,7	1.619,4	1.414,3	1.563,4	1.750,3
Deckungswerte	1.473,4	1.636,4	1.735,3	1.614,8	1.752,1	1.877,3
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(908,2)</i>	<i>(1.033,8)</i>	<i>(1.107,3)</i>	<i>(1.110,9)</i>	<i>(1.203,6)</i>	<i>(1.287,6)</i>
<i>(davon weitere Deckungswerte (§ 20 Abs. 2 PfandBG))</i>	<i>(95,5)</i>	<i>(97,0)</i>	<i>(97,3)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>
<i>(davon Derivate)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>
Überdeckung	248,2	171,7	115,9	200,5	188,7	127,0

*) ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken

Laufzeitstruktur

Mio €	31.12.2011	31.12.2010
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	594,1	629,7
mehr als einem bis zu zwei Jahren	615,6	591,8
mehr als zwei bis zu drei Jahren	780,4	686,1
mehr als drei bis zu vier Jahren	194,7	770,9
mehr als vier bis zu fünf Jahren	326,4	170,3
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	1.009,6	1.179,5
mehr als zehn Jahren	331,7	442,7
	3.852,5	4.471,0
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	5.747,6	5.459,2
mehr als einem bis zu zwei Jahren	36,7	142,4
mehr als zwei bis zu drei Jahren	49,7	84,5
mehr als drei bis zu vier Jahren	44,5	7,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	12,1	7,8
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	5,0	26,4
mehr als zehn Jahren	0,0	0,0
	5.895,6	5.727,6
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	127,5	39,0
mehr als einem bis zu zwei Jahren	-3,6	127,5
mehr als zwei bis zu drei Jahren	28,3	-3,6
mehr als drei bis zu vier Jahren	131,1	28,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	38,9	131,1
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	199,3	241,7
mehr als zehn Jahren	703,8	850,3
	1.225,3	1.414,3
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	495,0	462,9
mehr als einem bis zu zwei Jahren	177,9	93,0
mehr als zwei bis zu drei Jahren	165,2	157,9
mehr als drei bis zu vier Jahren	47,1	122,2
mehr als vier bis zu fünf Jahren	33,2	72,1
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	252,9	330,6
mehr als zehn Jahren	302,1	376,1
	1.473,4	1.614,8

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen

Mio €	31.12.2011	31.12.2010
bis zu 500 Tsd €	6,7	11,0
von mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	1.060,4	1.069,9
von mehr als 5 Mio €	4.828,5	4.646,7
	5.895,6	5.727,6

Registerland der beliehenen Schiffe und Schiffsbauwerke

Mio €	31.12.2011	31.12.2010
Seeschiffe		
Antigua und Barbuda	16,3	17,4
Bahamas	256,8	248,2
Bermuda	0,0	0,0
Chile	0,7	1,5
Deutschland	2.324,7	2.326,3
Gibraltar	2,7	19,0
Griechenland	606,1	474,9
Großbritannien	96,9	90,3
Hongkong	268,9	202,2
Insel Man	80,7	75,2
Italien	189,8	163,4
Kaimaninseln	3,9	4,4
Liberia	326,1	315,6
Malta	431,8	273,0
Marshallinseln	505,4	519,0
Niederlande	70,0	65,1
Norwegen	59,5	70,3
Panama	193,0	210,0
Portugal	0,0	2,6
Schweden	0,0	0,0
Singapur	48,9	52,9
Türkei	10,6	14,8
Vanuatu	0,0	3,0
Zypern	284,0	260,7
	5.776,8	5.409,8
Binnenschiffe		
Deutschland	0,0	0,0
Gesamt	5.776,8	5.409,8

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen

Mio €	31.12.2011	31.12.2010
Staaten		
Belgien	0,0	25,0
Griechenland	0,0	0,0
Italien	35,5	85,0
Litauen	0,0	10,0
Polen	0,0	40,0
Spanien	0,0	0,0
Ungarn	0,0	20,0
	35,5	180,0
Regionale Gebietskörperschaften		
Deutschland	652,6	722,6
Spanien	20,0	20,0
	672,6	742,6
Sonstige Schuldner		
mit Sitz in:		
Deutschland	559,0	574,7
Frankreich	5,0	0,0
Griechenland	0,0	27,5
Großbritannien	23,5	0,0
Japan	10,0	10,0
Luxemburg	4,1	0,0
Österreich	152,0	70,0
Slowenien	10,0	10,0
Vereinigte Staaten	1,7	0,0
	765,3	692,2
	1.473,4	1.614,8

Rückständige Leistungen

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