

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio €	30.06.2011			30.06.2010		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	3.945,6	4.156,9	4.361,0	5.717,8	6.068,2	6.241,1
<i>(davon Pfandbriefumlauf)</i>	<i>(3.945,6)</i>	<i>(4.138,9)</i>	<i>(4.343,8)</i>	<i>(5.484,5)</i>	<i>(5.827,6)</i>	<i>(6.008,8)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(18,0)</i>	<i>(17,2)</i>	<i>(233,3)</i>	<i>(240,6)</i>	<i>(232,3)</i>
Deckungswerte	5.392,7	5.696,9	5.721,3	6.534,2	6.912,0	6.929,8
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(5.112,1)</i>	<i>(5.402,4)</i>	<i>(5.420,4)</i>	<i>(5.858,4)</i>	<i>(6.192,2)</i>	<i>(6.198,8)</i>
<i>davon weitere Deckungswerte (§ 26 PfandBG)</i>	<i>(60,0)</i>	<i>(66,0)</i>	<i>(67,5)</i>	<i>(552,9)</i>	<i>(586,5)</i>	<i>(595,1)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(129,7)</i>	<i>(134,4)</i>	<i>(138,2)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(3,3)</i>	<i>(4,1)</i>
Risikobarwert nach Zinsstresstest			1.360,3			688,7
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			-118,1			-29,4
Über-/ Unterdeckung	1.447,1	1.540,0	1.242,2	816,4	843,8	659,3
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1.430,9	1.568,5	1.767,0	1.422,7	1.636,7	1.789,5
Deckungswerte	1.558,5	1.670,7	1.797,7	1.638,4	1.832,0	1.938,6
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(1.025,9)</i>	<i>(1.100,4)</i>	<i>(1.186,6)</i>	<i>(1.181,2)</i>	<i>(1.317,2)</i>	<i>(1.390,2)</i>
<i>(davon weitere Deckungswerte (§ 20 Abs. 2 PfandBG))</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>
<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	127,6	102,2	30,7	215,7	195,3	149,1

*) ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken

Laufzeitstruktur

Mio €	30.06.2011	30.06.2010
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	307,1	869,8
mehr als einem bis zu zwei Jahren	789,2	1.079,8
mehr als zwei bis zu drei Jahren	549,9	739,8
mehr als drei bis zu vier Jahren	525,3	420,5
mehr als vier bis zu fünf Jahren	347,6	500,8
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	1.025,1	1.250,4
mehr als zehn Jahren	401,4	623,4
	3.945,6	5.484,5
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	5.197,3	6.109,5
mehr als einem bis zu zwei Jahren	101,7	106,3
mehr als zwei bis zu drei Jahren	48,8	147,3
mehr als drei bis zu vier Jahren	15,3	77,8
mehr als vier bis zu fünf Jahren	29,3	42,2
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	0,3	51,1
mehr als zehn Jahren	0,0	0,0
	5.392,7	6.534,2
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	148,9	6,8
mehr als einem bis zu zwei Jahren	17,5	152,3
mehr als zwei bis zu drei Jahren	11,3	21,0
mehr als drei bis zu vier Jahren	23,2	15,0
mehr als vier bis zu fünf Jahren	154,0	12,6
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	194,8	337,2
mehr als zehn Jahren	881,2	877,8
	1.430,9	1.422,7
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	441,6	369,9
mehr als einem bis zu zwei Jahren	194,0	153,3
mehr als zwei bis zu drei Jahren	62,9	195,6
mehr als drei bis zu vier Jahren	122,1	50,0
mehr als vier bis zu fünf Jahren	126,4	114,5
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	253,6	330,1
mehr als zehn Jahren	357,9	425,0
	1.558,5	1.638,4

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen

Mio €	30.06.2011	30.06.2010
bis zu 500 Tsd €	10,7	10,5
von mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	1.113,0	921,8
von mehr als 5 Mio €	4.269,0	5.601,9
	5.392,7	6.534,2

Registerland der beliebigen Schiffe und Schiffsbauwerke

Mio €	30.06.2011	30.06.2010
Seeschiffe		
Antigua und Barbuda	16,5	19,8
Bahamas	213,9	284,6
Chile	1,0	3,8
Deutschland	2.109,1	2.473,4
Gibraltar	18,2	19,5
Griechenland	467,6	531,3
Großbritannien	81,2	101,4
Hongkong	231,4	241,0
Insel Man	76,0	65,3
Israel	0,0	0,0
Italien	172,7	184,3
Kaimaninseln	3,8	5,1
Liberia	268,6	376,6
Malta	331,6	303,7
Marshallinseln	459,9	611,0
Niederlande	66,4	68,0
Norwegen	60,5	39,0
Österreich	0,0	0,0
Panama	196,4	193,7
Portugal	0,0	2,6
Singapur	46,8	45,2
Türkei	12,6	17,5
Vanuatu	2,5	3,5
Zypern	275,4	268,1
	5.112,1	5.858,4
Binnenschiffe	0,0	0,0
Gesamt	5.112,1	5.858,4

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen

Mio €	30.06.2011	30.06.2010
Staaten		
Belgien	25,0	25,0
Griechenland	0,0	0,0
Italien	85,7	84,4
Litauen	10,0	10,0
Polen	40,0	40,0
Spanien	0,0	20,0
Ungarn	20,0	20,0
	180,7	199,4
Regionale Gebietskörperschaften		
Deutschland	697,6	757,6
Spanien	20,0	0,0
	717,6	757,6
Sonstige Schuldner		
mit Sitz in:		
Deutschland	555,2	538,9
Griechenland	0,0	27,5
Japan	10,0	10,0
Irland	0,0	25,0
Österreich	85,0	70,0
Slowenien	10,0	10,0
	660,2	681,4
	1.558,5	1.638,4

Rückständige Leistungen

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