

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio. €	30.9.2013			30.9.2012		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	2 787,4	3 085,8	3 171,3	4 071,9	4 522,3	4 637,1
darunter: Pfandbriefumlauf	2 758,9	3 035,9	3 121,3	3 962,3	4 376,4	4 490,1
darunter: Derivate ¹	28,5	49,9	49,9	109,6	145,9	147,0
Deckungswerte	3 251,2	3 438,5	3 444,6	4 547,8	4 828,9	4 841,1
darunter: Deckungsdarlehen	3 176,2	3 353,6	3 359,5	4 336,8	4 583,2	4 590,7
darunter: Deckungswerte § 26 PfandBG	–	–	–	111,0	120,9	122,1
darunter: Derivate ¹	–	–	–	–	19,2	18,6
Risikobarwert nach Zinsstresstest			273,3			204,0
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			–26,2			–77,0
Überdeckung	463,8	352,7	247,1	475,9	306,6	127,0
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1 534,1	1 772,1	1 912,7	1 052,8	1 329,8	1 465,9
Deckungswerte	2 113,5	2 298,4	2 363,8	1 261,4	1 450,4	1 528,1
darunter: Deckungsdarlehen	1 021,5	1 070,1	1 072,2	882,6	1 040,8	1 107,1
darunter: Deckungswerte § 20 Abs. 2 PfandBG	–	–	–	100,0	104,7	105,1
darunter: Derivate	–	–	–	–	–	–
Überdeckung	579,4	526,3	451,1	208,6	120,6	62,2

¹ Ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken.

Laufzeitstruktur

Mio. €	30.9.2013	30.9.2012
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	227,7	592,3
mehr als einem bis zu zwei Jahren	312,3	422,9
mehr als zwei bis zu drei Jahren	976,7	310,2
mehr als drei bis zu vier Jahren	385,6	1 259,4
mehr als vier bis zu fünf Jahren	146,6	383,3
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	558,4	682,6
mehr als zehn Jahren	151,6	311,6
Gesamt	2 758,9	3 962,3
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	3 218,1	4 370,2
mehr als einem bis zu zwei Jahren	16,4	48,2
mehr als zwei bis zu drei Jahren	6,6	57,5
mehr als drei bis zu vier Jahren	10,1	11,8
mehr als vier bis zu fünf Jahren	–	10,1
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	–	50,0
mehr als zehn Jahren	–	–
Gesamt	3 251,2	4 547,8
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	18,0	17,4
mehr als einem bis zu zwei Jahren	124,0	14,3
mehr als zwei bis zu drei Jahren	48,0	120,1
mehr als drei bis zu vier Jahren	20,5	44,0
mehr als vier bis zu fünf Jahren	585,0	16,3
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	267,5	248,5
mehr als zehn Jahren	471,1	592,2
Gesamt	1 534,1	1 052,8
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	392,7	394,4
mehr als einem bis zu zwei Jahren	286,8	176,8
mehr als zwei bis zu drei Jahren	299,1	73,7
mehr als drei bis zu vier Jahren	165,0	54,5
mehr als vier bis zu fünf Jahren	203,8	45,6
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	486,7	276,4
mehr als zehn Jahren	279,4	240,0
Gesamt	2 113,5	1 261,4

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen Mio. €	30.9.2013	30.9.2012
Bis zu 500 Tsd. €	8,9	5,2
Mehr als 500 Tsd. € bis zu 5 Mio. €	1 128,4	1 128,9
Mehr als 5 Mio. €	2 113,9	3 413,7
Gesamt	3 251,2	4 547,8

Registerland der beliehenen Schiffe und Schiffsbauwerke Mio. €	30.9.2013	30.9.2012
Seeschiffe	3 176,2	4 336,8
Antigua und Barbuda	8,2	10,2
Bahamas	148,0	199,3
Deutschland	1 360,5	1 718,1
Gibraltar	1,2	1,9
Griechenland	236,0	432,8
Großbritannien	36,0	57,2
Hongkong	125,8	205,0
Insel Man	34,8	60,2
Italien	96,5	131,2
Kaimaninseln	-	3,6
Liberia	270,2	327,1
Malta	237,7	318,3
Marshallinseln	258,2	361,7
Niederlande	48,9	57,0
Norwegen	42,7	62,6
Panama	105,0	160,5
Singapur	27,6	36,6
Türkei	7,3	15,0
Zypern	131,6	178,5
Binnenschiffe	-	-
Gesamt	3 176,2	4 336,8

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen Mio. €	30.9.2013	30.9.2012
Staaten	1 021,5	-
Deutschland	1 021,5	-
Regionale Gebietskörperschaften	637,0	652,6
Deutschland	637,0	652,6
Sonstige Schuldner mit Sitz in	455,0	608,8
Deutschland	350,0	444,2
Frankreich	-	20,0
Luxemburg	-	29,1
Niederlande	-	10,0
Österreich	60,0	100,0
Supranationale Organisationen ¹	45,0	-
USA	-	5,5
Gesamt	2 113,5	1 261,4

¹Deckungswerte gegenüber europäischen Institutionen (im Vorjahr Luxemburg)

Rückständige Leistungen

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