

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio. €	30.9.2012			30.9.2011		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	4 071,9	4 522,3	4 637,1	4 062,7	4 450,6	4 622,2
darunter: Pfandbriefumlauf	3 962,3	4 376,4	4 490,1	3 931,6	4 262,3	4 437,1
darunter: Derivate ¹	109,6	145,9	147,0	131,1	188,3	185,1
Deckungswerte	4 547,8	4 828,9	4 841,1	5 493,9	5 859,9	5 877,5
darunter: Deckungsdarlehen	4 336,8	4 583,2	4 590,7	5 373,1	5 689,6	5 703,5
darunter: Deckungswerte § 26 PfandBG	111,0	120,9	122,1	30,0	34,9	36,0
darunter: Derivate ¹	—	19,2	18,6	—	40,9	42,5
Risikobarwert nach Zinsstresstest			204,0			1 255,3
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			-77,0			-138,5
Überdeckung	475,9	306,6	127,0	1 431,2	1 409,3	1 116,8
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1 052,8	1 329,8	1 465,9	1 286,7	1 512,0	1 672,9
Deckungswerte	1 261,4	1 450,4	1 528,1	1 513,5	1 681,1	1 790,3
darunter: Deckungsdarlehen	882,6	1 040,8	1 107,1	928,2	1 050,0	1 126,6
darunter: Deckungswerte § 20 Abs. 2 PfandBG	100,0	104,7	105,1	90,0	90,7	90,8
darunter: Derivate	—	—	—	—	—	—
Überdeckung	208,6	120,6	62,2	226,8	169,1	117,4

¹ Ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken.

Laufzeitstruktur

Mio. €	30.9.2012	30.9.2011
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	592,3	432,1
mehr als einem bis zu zwei Jahren	422,9	814,4
mehr als zwei bis zu drei Jahren	310,2	623,0
mehr als drei bis zu vier Jahren	1 259,4	325,2
mehr als vier bis zu fünf Jahren	383,3	309,5
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	682,6	1 024,8
mehr als zehn Jahren	311,6	402,6
Gesamt	3 962,3	3 931,6
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	4 370,2	5 354,9
mehr als einem bis zu zwei Jahren	48,2	49,5
mehr als zwei bis zu drei Jahren	57,5	47,9
mehr als drei bis zu vier Jahren	11,8	32,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	10,1	4,4
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	50,0	4,9
mehr als zehn Jahren	—	—
Gesamt	4 547,8	5 493,9
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	17,4	133,9
mehr als einem bis zu zwei Jahren	14,3	17,4
mehr als zwei bis zu drei Jahren	120,1	14,3
mehr als drei bis zu vier Jahren	44,0	120,1
mehr als vier bis zu fünf Jahren	16,3	54,0
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	248,5	219,5
mehr als zehn Jahren	592,2	727,5
Gesamt	1 052,8	1 286,7
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	394,4	468,5
mehr als einem bis zu zwei Jahren	176,8	143,0
mehr als zwei bis zu drei Jahren	73,7	157,3
mehr als drei bis zu vier Jahren	54,5	72,2
mehr als vier bis zu fünf Jahren	45,6	92,9
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	276,4	253,0
mehr als zehn Jahren	240,0	326,6
Gesamt	1 261,4	1 513,5

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen Mio. €	30.9.2012	30.9.2011
Bis zu 500 Tsd. €	5,2	9,0
Mehr als 500 Tsd. € bis zu 5 Mio. €	1 128,9	1 024,7
Mehr als 5 Mio. €	3 413,7	4 460,2
Gesamt	4 547,8	5 493,9

Registerland der beliehenen Schiffe und Schiffsbauwerke Mio. €	30.9.2012	30.9.2011
Seeschiffe	4 336,8	5 373,1
Antigua und Barbuda	10,2	16,4
Bahamas	199,3	222,4
Chile	—	0,7
Deutschland	1 718,1	2 156,2
Gibraltar	1,9	2,8
Griechenland	432,8	522,1
Großbritannien	57,2	99,5
Hongkong	205,0	243,6
Insel Man	60,2	80,1
Italien	131,2	170,2
Kaimaninseln	3,6	4,1
Liberia	327,1	317,0
Malta	318,3	376,9
Marshallinseln	361,7	487,8
Niederlande	57,0	66,4
Norwegen	62,6	63,6
Panama	160,5	218,8
Singapur	36,6	48,7
Türkei	15,0	13,3
Zypern	178,5	262,5
Binnenschiffe	—	—
Gesamt	4 336,8	5 373,1

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen Mio. €	30.9.2012	30.9.2011
Staaten	–	120,2
Belgien	–	25,0
Italien	–	35,2
Polen	–	40,0
Ungarn	–	20,0
Regionale Gebietskörperschaften	652,6	692,6
Deutschland	652,6	672,6
Spanien	–	20,0
Sonstige Schuldner mit Sitz in	608,8	700,7
Deutschland	444,2	545,7
Frankreich	20,0	5,0
Japan	–	10,0
Luxemburg	29,1	–
Niederlande	10,0	–
Österreich	100,0	130,0
USA	5,5	–
Slowenien	–	10,0
Gesamt	1 261,4	1 513,5

Rückständige Leistungen

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