

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio €	31.03.2012			31.03.2011		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	4.856,3	5.265,8	5.417,7	4.573,8	4.764,9	4.985,4
<i>(davon Pfandbriefumlauf)</i>	<i>(4.790,4)</i>	<i>(5.165,4)</i>	<i>(5.317,5)</i>	<i>(4.573,8)</i>	<i>(4.742,0)</i>	<i>(4.962,3)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(65,9)</i>	<i>(100,4)</i>	<i>(100,2)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(22,9)</i>	<i>(23,1)</i>
Deckungswerte	5.633,3	5.986,6	6.004,6	5.770,9	6.097,0	6.128,6
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(5.459,5)</i>	<i>(5.792,7)</i>	<i>(5.808,2)</i>	<i>(5.281,3)</i>	<i>(5.581,1)</i>	<i>(5.602,2)</i>
<i>davon weitere Deckungswerte (§ 26 PfandBG)</i>	<i>(30,0)</i>	<i>(35,4)</i>	<i>(36,5)</i>	<i>(145,0)</i>	<i>(153,9)</i>	<i>(157,9)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(13,8)</i>	<i>(14,9)</i>	<i>(241,8)</i>	<i>(256,2)</i>	<i>(261,7)</i>
Risikobarwert nach Zinsstresstest			586,9			1.143,2
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			-10,9			-62,7
Über-/ Unterdeckung	777,0	720,8	576,0	1.197,1	1.332,1	1.080,5
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1.171,1	1.403,4	1.552,9	1.430,1	1.543,6	1.756,7
Deckungswerte	1.401,1	1.550,1	1.637,3	1.605,4	1.703,4	1.843,7
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(872,6)</i>	<i>(995,6)</i>	<i>(1.069,1)</i>	<i>(1.100,9)</i>	<i>(1.165,9)</i>	<i>(1.260,2)</i>
<i>(davon weitere Deckungswerte (§ 20 Abs. 2 PfandBG))</i>	<i>(94,0)</i>	<i>(95,6)</i>	<i>(95,7)</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	230,0	146,7	84,4	175,3	159,8	87,0

*) ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken

Laufzeitstruktur

Mio €	31.03.2012	31.03.2011
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	426,9	592,7
mehr als einem bis zu zwei Jahren	549,9	974,6
mehr als zwei bis zu drei Jahren	945,3	495,5
mehr als drei bis zu vier Jahren	1.171,7	695,9
mehr als vier bis zu fünf Jahren	374,3	322,2
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	989,4	1.083,8
mehr als zehn Jahren	332,9	409,1
	4.790,4	4.573,8
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	5.494,1	5.422,2
mehr als einem bis zu zwei Jahren	34,3	220,6
mehr als zwei bis zu drei Jahren	48,0	64,3
mehr als drei bis zu vier Jahren	42,9	7,7
mehr als vier bis zu fünf Jahren	13,5	30,7
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	0,5	25,4
mehr als zehn Jahren	0,0	0,0
	5.633,3	5.770,9
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	127,5	39,0
mehr als einem bis zu zwei Jahren	6,4	127,5
mehr als zwei bis zu drei Jahren	18,2	6,4
mehr als drei bis zu vier Jahren	131,0	18,2
mehr als vier bis zu fünf Jahren	38,9	131,0
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	214,5	228,0
mehr als zehn Jahren	634,6	880,0
	1.171,1	1.430,1
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	539,8	478,5
mehr als einem bis zu zwei Jahren	158,8	128,0
mehr als zwei bis zu drei Jahren	106,7	122,3
mehr als drei bis zu vier Jahren	83,8	97,2
mehr als vier bis zu fünf Jahren	20,0	147,2
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	242,0	280,7
mehr als zehn Jahren	250,0	351,5
	1.401,1	1.605,4

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen

Mio €	31.03.2012	31.03.2011
bis zu 500 Tsd €	7,1	12,6
von mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	1.008,6	1.101,1
von mehr als 5 Mio €	4.443,8	4.657,2
	5.459,5	5.770,9

Registerland der beliebigen Schiffe und Schiffsbauwerke

Mio €	31.03.2012	31.03.2011
Seeschiffe		
Antigua und Barbuda	15,5	16,2
Bahamas	247,9	226,0
Chile	0,2	1,0
Deutschland	2.147,6	2.193,3
Gibraltar	2,6	18,6
Griechenland	542,6	488,8
Großbritannien	94,1	85,9
Hongkong	255,1	236,4
Insel Man	98,4	68,5
Italien	163,6	178,9
Kaimaninseln	3,8	4,1
Liberia	391,0	303,6
Malta	409,3	302,1
Marshallinseln	444,6	492,2
Niederlande	69,3	62,4
Norwegen	61,8	64,3
Panama	181,9	205,1
Portugal	0,0	2,6
Singapur	45,4	48,0
Türkei	18,1	13,6
Vanuatu	0,0	2,8
Zypern	266,7	266,9
	5.459,5	5.281,3
Binnenschiffe		
Deutschland	0,0	0,0
Gesamt	5.459,5	5.281,3

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen

Mio €	31.03.2012	31.03.2011
Staaten		
Belgien	0,0	25,0
Italien	0,0	85,3
Litauen	0,0	10,0
Polen	0,0	40,0
Ungarn	0,0	20,0
	0,0	180,3
Regionale Gebietskörperschaften		
Deutschland	652,6	722,6
Spanien	20,0	20,0
	672,6	742,6
Sonstige Schuldner		
mit Sitz in:		
Deutschland	533,7	565,0
Frankreich	5,0	0,0
Griechenland	0,0	27,5
Großbritannien	23,0	0,0
Japan	10,0	10,0
Luxemburg	4,1	0,0
Österreich	151,0	70,0
USA	1,7	0,0
Slowenien	0,0	10,0
	728,5	682,5
	1.401,1	1.605,4

Rückständige Leistungen

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