



Veröffentlichung gem. § 28 Pfandbriefgesetz

Stand: 31. März 2017

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten

3

Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten

12

Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten

20

Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten

28

Gesamtbetrag der umlaufenden Hypothekendarlehen und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	1.835,6	2.007,6	1.864,1	2.048,6	1.805,9	1.978,0	1.870,2	2.054,9	1.805,9	1.978,0
Deckungsmasse	3.794,8	3.288,7	4.159,9	3.631,3	3.851,7	3.367,0	4.204,5	3.651,9	3.839,8	3.346,2
Überdeckung	1.959,2	1.281,1	2.295,8	1.582,7	2.045,8	1.389,0	2.334,3	1.597,0	2.033,9	1.368,2
Überdeckung in %	106,7	63,8	123,2	77,3	113,3	70,2	124,8	77,7	112,6	69,2

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016
USD	71,7	125,1

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2		Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	75,0	75,0
	Q1 / 2016	0,0	10,0	0,0	65,0	75,0

Hypothekendarlehen - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	1.835,6	2.007,6
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	19,48	20,28
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	3.794,8	3.288,7
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	74,13	75,40
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen des § 13 Abs. 1 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	0,0	0,0
Volumengewichteter Durchschnitt der seit der Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit in Jahren	6,7	7,0
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf in %	max. 60,0	max. 60,0

Laufzeitstruktur der Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2017		Q1 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	0,0	364,3	52,5	406,3
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	70,0	347,7	70,0	338,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	188,7	0,0	143,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	408,0	232,0	70,0	230,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	510,1	373,1	458,0	444,9
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	575,0	369,0	509,6	309,3
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	62,5	298,6	575,0	289,7
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	210,0	1.447,8	272,5	1.035,7
mehr als 10 Jahre	0,0	173,6	0,0	91,1
Gesamt	1.835,6	3.794,8	2.007,6	3.288,7

Verteilung der Hypothekendarlehen nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
bis zu 300 Tsd €	1.083,1	1.095,0
mehr als 300 Tsd € bis zu 1 Mio €	329,0	296,3
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	1.172,6	882,3
mehr als 10 Mio €	1.135,1	940,1
Gesamt	3.719,8	3.213,7

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (wohnwirtschaftlich)

in Mio €		Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke					
		Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familienhäuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und nicht ertrags- fähige Neubauten	Bauplätze	Gesamt
Deutschland	Q1 / 2017	185,2	715,0	1.944,7	0,0	0,7	2.845,6
	Q1 / 2016	186,9	712,1	1.313,3	0,0	0,1	2.212,4
Luxemburg	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Österreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
USA	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Gesamt	Q1 / 2017	185,2	715,0	1.944,7	0,0	0,7	2.845,6
	Q1 / 2016	186,9	712,1	1.313,3	0,0	0,1	2.212,4

Verteilung der Deckungswerte nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart (gewerblich)

in Mio €		Gewerblich genutzte Grundstücke						Gesamt
		Bürogebäude	Handelsgebäude	Industriegebäude	sonstige gewerblich genutzte Gebäude	Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	Bauplätze	
Deutschland	Q1 / 2017	276,0	170,1	9,1	211,4	0,0	0,0	666,6
	Q1 / 2016	297,4	200,8	8,9	220,7	0,0	0,0	727,8
Luxemburg	Q1 / 2017	137,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	137,5
	Q1 / 2016	143,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	143,5
Österreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	8,1	0,0	0,0	0,0	0,0	8,1
USA	Q1 / 2017	70,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	70,1
	Q1 / 2016	121,9	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	121,9
Gesamt	Q1 / 2017	483,6	170,1	9,1	211,4	0,0	0,0	874,2
	Q1 / 2016	562,8	208,9	8,9	220,7	0,0	0,0	1.001,3

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt
Deutschland	Q1 / 2017	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,1	0,1
Luxemburg	Q1 / 2017	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0
Österreich	Q1 / 2017	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0
USA	Q1 / 2017	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0
Gesamt	Q1 / 2017	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,1	0,1

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	12
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20
Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten	28

Gesamtbetrag der umlaufenden Öffentlichen Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	14.853,6	14.946,4	17.054,2	17.740,8	14.926,4	15.596,9	17.797,4	18.329,2	17.452,5	15.992,9
Deckungsmasse	16.857,7	18.719,3	19.141,2	21.804,3	17.014,9	19.282,1	19.885,5	22.454,8	19.258,0	19.383,6
Überdeckung	2.004,1	3.772,9	2.087,0	4.063,5	2.088,5	3.685,2	2.088,1	4.125,6	1.805,5	3.390,7
Überdeckung in %	13,5	25,2	12,2	22,9	14,0	23,6	11,7	22,5	10,3	21,2

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016
CHF	0,0	2,8
JPY	0,0	-143,3
USD	-1.126,6	-1.106,1

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe gemäß § 20 Abs. 2 Nr. 1 und Nr. 2

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1	Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2		Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
Deutschland	Q1 / 2017	0,0	452,2	120,0	452,2
	Q1 / 2016	0,0	474,7	70,0	474,7

Öffentliche Pfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	14.853,6	14.946,4
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	93,61	88,58
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	16.857,7	18.719,3
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	81,47	85,51
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten	0,0	0,0

Laufzeitstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2017		Q1 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	604,5	1.558,9	1.595,5	1.087,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	973,5	911,3	357,6	1.311,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	427,1	834,5	604,5	1.380,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	3.154,6	748,4	936,5	1.020,3
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	956,6	1.790,3	3.471,7	1.509,9
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.460,4	1.284,8	929,5	1.936,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	382,1	1.571,9	1.478,4	1.612,6
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	3.447,5	4.606,0	1.959,5	4.877,2
mehr als 10 Jahre	3.447,3	3.551,6	3.613,2	3.983,5
Gesamt	14.853,6	16.857,7	14.946,4	18.719,3

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
bis zu 10 Mio €	1.894,5	1.849,9
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	4.967,5	4.783,9
mehr als 100 Mio €	9.543,5	11.610,8
Gesamt	16.405,5	18.244,6

Verteilung der Öffentlichen Pfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Schuldnern (inkl. sichernde Überdeckung)

in Mio €		Forderungen ohne Gewährleistung					Forderungen mit Gewährleistung					Gesamt	
		Gesamt	davon				Gesamt	davon					(durch ECA verbürgt)
			Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige		
Deutschland	Q1 / 2017	13.570,7	380,0	4.358,2	4.115,8	4.716,7	1.749,1	702,1	425,3	559,3	62,4	(629,3)	15.319,8
	Q1 / 2016	15.542,0	610,0	5.386,7	4.088,7	5.456,6	1.697,0	560,8	518,9	552,7	64,6	(492,2)	17.239,0
Belgien	Q1 / 2017	30,0	0,0	0,0	0,0	30,0	24,6	0,0	0,0	0,0	24,6	(24,6)	54,6
	Q1 / 2016	30,0	0,0	0,0	0,0	30,0	25,1	0,0	0,0	0,0	25,1	(25,1)	55,1
Dänemark	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	72,2	0,0	0,0	0,0	72,2	(72,2)	72,2
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	27,9	0,0	0,0	0,0	27,9	(27,9)	27,9
Finnland	Q1 / 2017	5,0	0,0	0,0	0,0	5,0	53,1	0,0	0,0	0,0	53,1	(53,1)	58,1
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	62,1	0,0	0,0	0,0	62,1	(62,1)	62,1
Frankreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	123,5	123,5	0,0	0,0	0,0	(65,3)	123,5
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	52,3	52,3	0,0	0,0	0,0	(52,3)	52,3
Großbritannien	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	42,6	42,6	0,0	0,0	0,0	(42,6)	42,6
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	47,8	47,8	0,0	0,0	0,0	(47,8)	47,8
Kanada	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	31,1	31,1	0,0	0,0	0,0	(0,0)	31,1
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	68,1	68,1	0,0	0,0	0,0	(0,0)	68,1
Lettland	Q1 / 2017	34,0	0,0	0,0	34,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	34,0
	Q1 / 2016	36,7	0,0	0,0	36,7	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	36,7
Luxemburg	Q1 / 2017	25,0	0,0	0,0	0,0	25,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	25,0
	Q1 / 2016	25,0	0,0	0,0	0,0	25,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	25,0
Niederlande	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	49,1	49,1	0,0	0,0	0,0	(49,1)	49,1
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	36,8	36,8	0,0	0,0	0,0	(36,8)	36,8
Österreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	46,0	46,0	0,0	0,0	0,0	(46,0)	46,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0
Schweiz	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	2,2	0,0	0,0	0,0	2,2	(2,2)	2,2
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	2,8	0,0	0,0	0,0	2,8	(2,8)	2,8
USA	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	547,3	417,1	0,0	0,0	130,2	(417,1)	547,3
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	591,0	472,8	0,0	0,0	118,2	(472,8)	591,0
Gesamt	Q1 / 2017	13.664,7	380,0	4.358,2	4.149,8	4.776,7	2.740,8	1.411,5	425,3	559,3	344,7	(1.401,5)	16.405,5
	Q1 / 2016	15.633,7	610,0	5.386,7	4.125,4	5.511,6	2.610,9	1.238,6	518,9	552,7	300,7	(1.219,8)	18.244,6

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen inklusive Verteilung nach Staaten

in Mio €		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *					Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Deckungsforderung beträgt				
		Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)	Staat	Regionale Gebietskörperschaft	Örtliche Gebietskörperschaft	Sonstige Schuldner	(durch ECA verbürgt)
Deutschland	Q1 / 2017	50,6	0,0	0,0	0,0	(50,6)	38,5	0,0	0,0	0,0	(38,5)
	Q1 / 2016	31,7	0,0	0,0	0,0	(31,7)	65,4	0,0	0,0	0,0	(65,4)
Belgien	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Dänemark	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Finnland	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Frankreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Großbritannien	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Kanada	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Lettland	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Luxemburg	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Niederlande	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Österreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Schweiz	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,6	(0,6)	0,0	0,0	0,0	2,8	(2,8)
USA	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)	0,0	0,0	0,0	0,0	(0,0)
Gesamt	Q1 / 2017	50,6	0,0	0,0	0,0	(50,6)	38,5	0,0	0,0	0,0	(38,5)
	Q1 / 2016	31,7	0,0	0,0	0,6	(32,3)	65,4	0,0	0,0	2,8	(68,2)

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	12
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20
Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten	28

Gesamtbetrag der umlaufenden Schiffspfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	80,0	80,0	80,7	81,4	79,1	77,8	80,6	81,2	79,1	81,4
Deckungsmasse	315,0	230,5	343,6	256,3	338,4	253,0	345,2	257,4	292,4	215,8
Überdeckung	235,0	150,5	262,9	174,9	259,3	175,2	264,6	176,2	213,3	134,4
Überdeckung in %	293,8	188,1	325,8	214,9	327,8	225,2	328,3	217,0	269,7	165,1

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016
USD	276,0	241,3

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe gemäß § 26 Abs. 1 Nr. 2, Nr. 3 und Nr. 4 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2	Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	58,5	58,5
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	6,0	6,0

Schiffspfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	80,0	80,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	62,50	62,50
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	315,0	230,5
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	18,57	2,60
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	0,0	0,0

Laufzeitstruktur der Schiffspfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2017		Q1 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	50,0	17,8	0,0	18,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	0,0	17,2	0,0	17,2
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	30,0	56,9	50,0	14,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,0	38,7	0,0	13,8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,0	52,9	30,0	47,8
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,0	32,4	0,0	26,2
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	43,3	0,0	20,3
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	52,4	0,0	71,5
mehr als 10 Jahre	0,0	3,4	0,0	1,1
Gesamt	80,0	315,0	80,0	230,5

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
bis zu 500 Tsd €	0,4	0,0
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	49,1	34,6
mehr als 5 Mio €	207,0	189,9
Gesamt	256,5	224,5

Verteilung der Schiffspfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach See- und Binnenschiffen

in Mio €		Seeschiffe						Binnenschiffe	Gesamt
		Gesamt	davon						
			Bulker	Containerschiff	Mehrzweckfrachter	Tanker	Sonstige		
Deutschland	Q1 / 2017	127,7	10,2	26,2	8,2	62,8	20,3	0,0	127,7
	Q1 / 2016	156,9	15,1	72,7	4,4	33,2	31,5	0,0	156,9
Großbritannien	Q1 / 2017	33,3	0,0	0,0	0,0	0,0	33,3	0,0	33,3
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Kroatien	Q1 / 2017	26,6	0,0	0,0	0,0	26,6	0,0	0,0	26,6
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Liberia	Q1 / 2017	3,2	0,0	2,6	0,0	0,6	0,0	0,0	3,2
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Malta	Q1 / 2017	33,5	15,5	0,0	0,0	18,0	0,0	0,0	33,5
	Q1 / 2016	27,4	27,4	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	27,4
Marshall-Inseln	Q1 / 2017	32,2	0,0	0,0	0,0	32,2	0,0	0,0	32,2
	Q1 / 2016	21,3	0,0	0,0	0,0	21,3	0,0	0,0	21,3
Zypern	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q1 / 2016	18,9	18,9	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	18,9
Gesamt	Q1 / 2017	256,5	25,7	28,8	8,2	140,2	53,6	0,0	256,5
	Q1 / 2016	224,5	61,4	72,7	4,4	54,5	31,5	0,0	224,5

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen *	0,4	0,0
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	0,0	0,0

* Die angegebenen rückständigen Leistungen sind nicht Bestandteil der ausgewiesenen Deckungsmasse.

Inhalt

Angaben zu Hypothekendarlehen und deren Deckungswerten	3
Angaben zu Öffentlichen Darlehen und deren Deckungswerten	12
Angaben zu Schiffsdarlehen und deren Deckungswerten	20
Angaben zu Flugzeugdarlehen und deren Deckungswerten	28

Gesamtbetrag der umlaufenden Flugzeugpfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungswerte in Höhe von Nennwert, Barwert und Risikobarwert sowie Nettobarwerte nach § 6 PfandBarwertV pro Fremdwährungsposition

in Mio €	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * + 250 bp		Risikobarwert * - 250 bp		Risikobarwert * Währungstress	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	1.006,0	1.006,0	1.027,3	1.041,3	999,9	989,4	1.025,7	1.039,6	999,9	989,4
Deckungsmasse	1.796,3	1.198,1	1.938,2	1.310,5	1.857,7	1.257,7	1.978,8	1.337,3	1.678,9	1.087,3
Überdeckung	790,3	192,1	910,9	269,2	857,8	268,3	953,1	297,7	679,0	97,9
Überdeckung in %	78,6	19,1	88,7	25,9	85,8	27,1	92,9	28,6	67,9	9,9

* Statische Methode gem. §§ 5, 6 PfandBarwertV

in Mio €	Nettobarwert nach § 6 PfandBarwertV	
	Q1 / 2017	Q1 / 2016
GBP	20,8	27,2
USD	1.061,1	1.007,8

Weitere Deckungswerte für Flugzeugpfandbriefe gemäß § 26f Abs. 1 Nr. 2, Nr. 3 und Nr. 4 inklusive sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 und Liquiditätssicherung gemäß § 4 Abs. 1a

in Mio €		Forderungen i.S.d. § 26f Abs. 1 Nr. 2	Forderungen i.S.d. § 26f Abs. 1 Nr. 3		Forderungen i.S.d. § 26f Abs. 1 Nr. 4	Gesamt
			Gesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	570,0	570,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	35,0	35,0

Flugzeugpfandbriefe - Kennzahlen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Pfandbriefumlauf	1.006,0	1.006,0
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe in %	100,00	100,00
Anteil Derivate	0,0	0,0
Deckungsmasse	1.796,3	1.198,1
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse in %	66,50	55,85
Anteil Derivate	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26f Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen des § 26f Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	0,0	0,0

Laufzeitstruktur der Flugzeugpfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

in Mio €	Q1 / 2017		Q1 / 2016	
	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse	Pfandbriefumlauf	Deckungsmasse
bis zu 6 Monate	501,0	248,2	0,0	117,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	0,0	240,0	0,0	97,6
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	0,0	156,1	501,0	76,4
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	500,0	118,2	0,0	106,5
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	5,0	367,8	500,0	256,5
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	0,0	278,3	5,0	100,4
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,0	137,4	0,0	174,1
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,0	214,4	0,0	230,3
mehr als 10 Jahre	0,0	35,9	0,0	38,8
Gesamt	1.006,0	1.796,3	1.006,0	1.198,1

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Größenklassen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
bis zu 500 Tsd €	0,2	0,8
mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	68,6	54,8
mehr als 5 Mio €	1.157,5	1.107,5
Gesamt	1.226,3	1.163,1

Verteilung der Flugzeugpfandbriefdeckung nach Staaten, dabei Trennung nach Flugzeugtypen

in Mio €		Business Jet	Freighter	Narrowbody	Regional Jet	Turboprop	Ultralarge	Widebody	Gesamt
Deutschland	Q1 / 2017	0,0	124,2	54,4	0,0	19,7	0,0	0,0	198,3
	Q1 / 2016	0,0	126,3	84,6	0,0	21,3	0,0	0,0	232,2
Finnland	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	40,2	40,2
	Q1 / 2016	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	42,0	42,0
Frankreich	Q1 / 2017	0,0	0,0	15,4	0,0	0,0	69,3	36,5	121,2
	Q1 / 2016	0,0	0,0	15,5	0,0	0,0	64,0	59,6	139,1
Großbritannien	Q1 / 2017	0,0	0,0	31,5	8,9	38,8	77,7	0,0	156,9
	Q1 / 2016	0,0	0,0	35,7	10,7	28,7	145,0	0,0	220,1
Irland	Q1 / 2017	0,0	0,0	55,6	0,0	0,0	0,0	43,5	99,1
	Q1 / 2016	0,0	0,0	66,3	0,0	0,0	0,0	45,4	111,7
Luxemburg	Q1 / 2017	0,0	53,6	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	53,6
	Q1 / 2016	0,0	10,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	10,2
Norwegen	Q1 / 2017	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
	Q1 / 2016	0,0	0,0	6,4	0,0	0,0	0,0	0,0	6,4
Schweiz	Q1 / 2017	0,0	0,0	32,4	0,0	0,0	0,0	0,0	32,4
	Q1 / 2016	0,0	0,0	20,9	0,0	0,0	0,0	0,0	20,9
USA	Q1 / 2017	0,0	107,4	346,1	71,1	0,0	0,0	0,0	524,6
	Q1 / 2016	0,0	0,0	342,4	38,1	0,0	0,0	0,0	380,5
Gesamt	Q1 / 2017	0,0	285,2	535,4	80,0	58,5	147,0	120,2	1.226,3
	Q1 / 2016	0,0	136,5	571,8	48,8	50,0	209,0	147,0	1.163,1

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen

in Mio €	Q1 / 2017	Q1 / 2016
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0,0	0,0
Gesamtbetrag der Deckungsforderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Deckungsforderung beträgt	0,0	0,0