

Report gem. § 28 Pfandbriefgesetz (PfandBG) per 30.06.2017
Nominal- und Barwertdeckung der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß §28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG. Für die Berechnung der Risikobarwerte wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

| Hypothekendarbriefe | Nominalwert | | Barwert | | Risikobarwert incl. Währungsstress mind. + 100 bp | | Risikobarwert incl. Währungsstress mind. - 100 bp | |
|------------------------------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|--|----------------|--|----------------|
| | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 |
| Beträge in Mio € | | | | | | | | |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 768,2 | 767,2 | 817,4 | 842,5 | 778,4 | 805,2 | 844,7 | 856,7 |
| darunter Derivate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Deckungsmasse | 1.341,4 | 1.224,8 | 1.467,8 | 1.372,2 | 1.414,7 | 1.325,5 | 1.489,8 | 1.373,4 |
| darunter Derivate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Überdeckung | 573,2 | 457,6 | 650,4 | 529,7 | 636,3 | 520,3 | 645,1 | 516,7 |
| Überdeckung in % | 74,6 | 59,6 | 79,6 | 62,9 | 81,7 | 64,6 | 76,4 | 60,3 |

| Öffentliche Pfandbriefe | Nominalwert | | Barwert | | Risikobarwert incl. Währungsstress mind. + 100 bp | | Risikobarwert incl. Währungsstress mind. - 100 bp | |
|------------------------------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|--|----------------|--|----------------|
| | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 |
| Beträge in Mio € | | | | | | | | |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 2.974,8 | 3.335,1 | 3.387,0 | 3.940,1 | 3.146,9 | 3.688,7 | 3.586,8 | 4.053,6 |
| darunter Derivate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Deckungsmasse | 3.248,6 | 3.619,7 | 3.678,2 | 4.361,6 | 3.407,1 | 4.056,2 | 3.911,3 | 4.511,0 |
| darunter Derivate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Überdeckung | 273,8 | 284,6 | 291,2 | 421,5 | 260,2 | 367,5 | 324,5 | 457,4 |
| Überdeckung in % | 9,2 | 8,5 | 8,6 | 10,7 | 8,3 | 10,0 | 9,0 | 11,3 |

| Schiffspfandbriefe | Nominalwert | | Barwert | | Risikobarwert incl. Währungsstress mind. + 100 bp | | Risikobarwert incl. Währungsstress mind. - 100 bp | |
|------------------------------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|--|----------------|--|----------------|
| | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 | Q2 2017 | Q2 2016 |
| Beträge in Mio € | | | | | | | | |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 79,1 | 165,6 | 85,5 | 178,6 | 83,7 | 175,2 | 85,7 | 178,2 |
| darunter Derivate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Deckungsmasse | 131,5 | 239,7 | 139,7 | 252,3 | 128,4 | 230,1 | 129,4 | 231,7 |
| darunter Derivate | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Überdeckung | 52,4 | 74,1 | 54,2 | 73,7 | 44,7 | 54,9 | 43,7 | 53,5 |
| Überdeckung in % | 66,2 | 44,7 | 63,4 | 41,3 | 53,4 | 31,3 | 51,0 | 30,0 |

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG

| Hypothekendarfandbriefe | Q2 2017 | | Q2 2016 | |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------|----------------------------|-------------------------|
| | Pfandbriefumlauf Mio. € | Deckungsmasse Mio. € | Pfandbriefumlauf Mio. € | Deckungsmasse Mio. € |
| Restlaufzeit: | | | | |
| Bis 0,5 Jahre | 15,0 | 141,5 | 80,0 | 122,8 |
| > 0,5 Jahre bis 1 Jahr | 55,0 | 77,1 | 25,0 | 63,6 |
| > 1 Jahr bis 1,5 Jahre | 6,8 | 65,6 | 15,0 | 61,6 |
| > 1,5 Jahre bis 2 Jahre | 170,0 | 72,1 | 64,0 | 74,0 |
| > 2 Jahre bis 3 Jahre | 147,0 | 132,8 | 151,8 | 139,7 |
| > 3 Jahre bis 4 Jahre | 6,0 | 179,6 | 147,0 | 116,8 |
| > 4 Jahre bis 5 Jahre | 139,3 | 127,3 | 6,0 | 166,9 |
| > 5 Jahre bis 10 Jahre | 107,0 | 465,4 | 156,3 | 417,2 |
| > 10 Jahre | 122,1 | 80,0 | 122,1 | 62,2 |

| Öffentliche Pfandbriefe | Q2 2017 | | Q2 2016 | |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------|----------------------------|-------------------------|
| | Pfandbriefumlauf Mio. € | Deckungsmasse Mio. € | Pfandbriefumlauf Mio. € | Deckungsmasse Mio. € |
| Restlaufzeit: | | | | |
| Bis 0,5 Jahre | 157,6 | 217,4 | 204,7 | 265,9 |
| > 0,5 Jahre bis 1 Jahr | 343,6 | 152,1 | 155,2 | 170,2 |
| > 1 Jahr bis 1,5 Jahre | 79,0 | 132,0 | 157,6 | 200,2 |
| > 1,5 Jahre bis 2 Jahre | 107,8 | 96,4 | 343,6 | 149,0 |
| > 2 Jahre bis 3 Jahre | 268,0 | 336,4 | 187,2 | 245,1 |
| > 3 Jahre bis 4 Jahre | 195,5 | 365,2 | 268,0 | 290,7 |
| > 4 Jahre bis 5 Jahre | 99,5 | 170,2 | 195,5 | 293,1 |
| > 5 Jahre bis 10 Jahre | 857,0 | 866,5 | 876,5 | 893,9 |
| > 10 Jahre | 866,8 | 912,4 | 946,8 | 1.111,6 |

| Schiffspfandbriefe | Q2 2017 | | Q2 2016 | |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------|----------------------------|-------------------------|
| | Pfandbriefumlauf Mio. € | Deckungsmasse Mio. € | Pfandbriefumlauf Mio. € | Deckungsmasse Mio. € |
| Restlaufzeit: | | | | |
| Bis 0,5 Jahre | 10,0 | 13,8 | 63,5 | 30,7 |
| > 0,5 Jahre bis 1 Jahr | 20,0 | 13,5 | 10,0 | 28,5 |
| > 1 Jahr bis 1,5 Jahre | 3,0 | 14,8 | 10,0 | 13,4 |
| > 1,5 Jahre bis 2 Jahre | - | 9,9 | 20,0 | 19,3 |
| > 2 Jahre bis 3 Jahre | 10,0 | 40,8 | 3,0 | 28,0 |
| > 3 Jahre bis 4 Jahre | 2,6 | 13,7 | 10,0 | 57,0 |
| > 4 Jahre bis 5 Jahre | 30,5 | 7,8 | 15,6 | 37,8 |
| > 5 Jahre bis 10 Jahre | 3,0 | 17,2 | 33,5 | 24,8 |
| > 10 Jahre | - | - | - | 0,2 |

Aufschlüsselung der zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendeten Forderungen nach Größenklassen 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1a PfandBG

| Deckungswerte | Q2 2017 Mio. € | Q2 2016 Mio. € |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Bis einschließlich 300 Tsd. € | 305,8 | 330,8 |
| Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. € | 198,8 | 191,0 |
| Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. € | 680,3 | 554,5 |
| Mehr als 10 Mio. € | 136,5 | 105,5 |
| Summe | 1.321,4 | 1.181,8 |

Aufschlüsselung der zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen nach Größenklassen 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

| Deckungswerte | Q2 2017 Mio. € | Q2 2016 Mio. € |
|--|--------------------------|--------------------------|
| Bis einschließlich 10 Mio. € | 1.115,4 | 1.185,2 |
| Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. € | 1.154,6 | 1.148,9 |
| Mehr als 100 Mio. € | 706,4 | 988,5 |
| Summe | 2.976,4 | 3.322,6 |

Aufschlüsselung der zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendeten Forderungen nach Größenklassen 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 4 Nr. 1a PfandBG

| Deckungswerte | Q2 2017 Mio. € | Q2 2016 Mio. € |
|---|--------------------------|--------------------------|
| Bis einschließlich 500 Tsd. € | 0,6 | 0,7 |
| Mehr als 500 Tsd. € bis einschließlich 5 Mio. € | 92,8 | 109,8 |
| Mehr als 5 Mio. € | 14,3 | 51,1 |
| Summe | 107,7 | 161,6 |

Verteilung der zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendeten Forderungen nach Staaten, dabei Aufschlüsselung nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 b, c und Nr. 2 PfandBG

| | | Deckungswerte | | | | | | | | | | | | | | Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | Gesamt- betrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5% der Forderung beträgt | |
|---------------------------------------|------------|---------------|-------|-------------------------|--|------------------------------|---|-----------|------------|-------|------------------|---------------------|-----------------------|---|---|---|--|-----------|
| Staat | 2. Quartal | Insgesamt | | Wohnwirtschaftlich | | | | | Gewerblich | | | | | | | | | |
| | | Insgesamt | davon | Eigentums- wohnungen | Ein- und Zwei- familien- häuser | Mehr- familien- häuser | Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten | Bauplätze | Insgesamt | davon | Büro- gebäude | Handels- gebäude | Industrie- gebäude | Sonstige gewerblich genutzte Gebäude | Unfertige und noch nicht er- tragfähige Neubauten | | | Bauplätze |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Gesamtsumme (alle Staaten) | Jahr 2017 | 1.321,4 | 519,3 | 62,3 | 182,2 | 274,6 | - | 0,2 | 802,1 | 110,0 | 177,8 | 63,5 | 450,3 | - | 0,5 | - | - | |
| | Jahr 2016 | 1.181,8 | 509,6 | 71,4 | 196,4 | 241,7 | - | 0,1 | 672,2 | 98,8 | 156,8 | 20,1 | 396,5 | - | - | - | - | |
| Deutschland | Jahr 2017 | 1.321,4 | 519,3 | 62,3 | 182,2 | 274,6 | - | 0,2 | 802,1 | 110,0 | 177,8 | 63,5 | 450,3 | - | 0,5 | - | - | |
| | Jahr 2016 | 1.181,8 | 509,6 | 71,4 | 196,4 | 241,7 | - | 0,1 | 672,2 | 98,8 | 156,8 | 20,1 | 396,5 | - | - | - | - | |

Verteilung der zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen nach Staaten 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

| | | Deckungswerte | | | | | | | | | |
|---------------------------------------|------------|---------------|--|----------------------|---|--|----------|-------------------------|---|--|----------|
| | | Summe | | davon geschuldet von | | | | davon gewährleistet von | | | |
| | | | in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | Zentralstaat | Regionale Gebiets- körperschaften | Örtliche Gebiets- körperschaften | Sonstige | Zentralstaat | Regionale Gebiets- körperschaften | Örtliche Gebiets- körperschaften | Sonstige |
| Staat | 2. Quartal | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € |
| Gesamtsumme (alle Staaten) | Jahr 2017 | 2.976,4 | - | - | 236,9 | 1.652,8 | 454,5 | - | 405,9 | 206,9 | 19,4 |
| | Jahr 2016 | 3.322,6 | - | - | 231,5 | 2.002,0 | 476,5 | - | 169,6 | 192,1 | 250,9 |
| Deutschland | Jahr 2017 | 2.976,4 | - | - | 236,9 | 1.652,8 | 454,5 | - | 405,9 | 206,9 | 19,4 |
| | Jahr 2016 | 3.322,6 | - | - | 231,5 | 2.002,0 | 476,5 | - | 169,6 | 192,1 | 250,9 |

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mind. 5 % der Forderung beträgt
2. Quartal 2017**

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

| Staat | 2. Quartal | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | | | | | Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt | | | | |
|-----------------------------------|------------|--|--------------|---------------------------------|--------------------------------|----------|--|--------------|---------------------------------|--------------------------------|----------|
| | | Summe | davon | | | | Summe | davon | | | |
| | | | Zentralstaat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige | | Zentralstaat | Regionale Gebietskörperschaften | Örtliche Gebietskörperschaften | Sonstige |
| Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | |
| Gesamtsumme (alle Staaten) | Jahr 2017 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | Jahr 2016 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Deutschland | Jahr 2017 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | Jahr 2016 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

Verteilung der zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendeten Forderungen nach Staaten, in denen die Schiffe und Schiffsbauwerke registriert sind sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % dieser Forderung beträgt 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 4 Nr. 1 b PfandBG und § 28 Abs. 4 Nr. 2 PfandBG

| Staat | 2. Quartal | Deckungswerte | | | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt |
|-----------------------------------|------------|---------------|------------|---------------|--|--|
| | | Summe | davon | | | |
| | | | Seeschiffe | Binnenschiffe | | |
| | | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € |
| Gesamtsumme - alle Staaten | Jahr 2017 | 107,7 | 102,1 | 5,6 | 3,5 | 13,7 |
| | Jahr 2016 | 161,6 | 153,7 | 7,9 | 0,8 | 6,3 |
| Deutschland | Jahr 2017 | 93,6 | 88,0 | 5,6 | | |
| | Jahr 2016 | 147,1 | 139,2 | 7,9 | | |
| Antigua und Barbuda | Jahr 2017 | 3,4 | 3,4 | - | | |
| | Jahr 2016 | - | - | - | | |
| Gibraltar | Jahr 2017 | 0,6 | 0,6 | - | | |
| | Jahr 2016 | 2,0 | 2,0 | - | | |
| Malta | Jahr 2017 | 2,9 | 2,9 | - | | |
| | Jahr 2016 | 3,3 | 3,3 | - | | |
| Marshallinseln | Jahr 2017 | 7,2 | 7,2 | - | | |
| | Jahr 2016 | 9,2 | 9,2 | - | | |

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 6 PfandBG

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarfandbriefe nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und Nr. 3 PfandBG

| Hypothekendarfandbriefe | | Summe | davon | | | |
|---------------------------------------|------------|--------|--|--|--------|--|
| | | | Ausgleichs- forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG | Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG | | Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG |
| | | | | Insgesamt | davon | |
| | | | gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | | | |
| Staat | 2. Quartal | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € |
| Gesamtsumme (alle Staaten) | Jahr 2017 | 20,0 | - | - | - | 20,0 |
| | Jahr 2016 | 43,0 | - | 10,0 | - | 33,0 |
| Deutschland | Jahr 2017 | 20,0 | - | - | - | 20,0 |
| | Jahr 2016 | 43,0 | - | 10,0 | - | 33,0 |

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

| Öffentliche Pfandbriefe | | Summe | davon | | | |
|---------------------------------------|------------|--------|--|--|--------|--|
| | | | Ausgleichs- forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG | Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG | | |
| | | | | Insgesamt | davon | |
| | | | gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | | | |
| Staat | 2. Quartal | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | |
| Gesamtsumme (alle Staaten) | Jahr 2017 | 272,2 | - | 272,2 | - | |
| | Jahr 2016 | 297,1 | - | 297,1 | - | |
| Deutschland | Jahr 2017 | 272,2 | - | 272,2 | - | |
| | Jahr 2016 | 297,1 | - | 297,1 | - | |

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe nach § 26 Abs. 1 Nr. 2, Nr. 3 und Nr. 4 PfandBG

| Schiffspfandbriefe | | Summe | davon | | | |
|---------------------------------------|------------|--------|--|--|--------|--|
| | | | Ausgleichs- forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG | Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG | | Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4 PfandBG |
| | | | | Insgesamt | davon | |
| | | | gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 | | | |
| Staat | 2. Quartal | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € | Mio. € |
| Gesamtsumme (alle Staaten) | Jahr 2017 | 23,8 | - | 3,8 | - | 20,0 |
| | Jahr 2016 | 78,1 | - | 3,1 | - | 75,0 |
| Deutschland | Jahr 2017 | 23,8 | - | 3,8 | - | 20,0 |
| | Jahr 2016 | 78,1 | - | 3,1 | - | 75,0 |

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten 2. Quartal 2017

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 7, 8, 9, 10 und 11 PfandBG und § 28 Abs. 2 Nr. 3 PfandBG

| Hypothekendarlehen | | Q2 2017 | Q2 2016 |
|---|--------|---------|---------|
| Umlaufende Pfandbriefe | Mio. € | 768,2 | 767,2 |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe; § 28 Abs. 1 Nr. 9 | % | 69,4 | 65,5 |
| Deckungsmasse | Mio. € | 1.341,4 | 1.224,8 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 überschreiten; § 28 Abs. 1 Nr. 7 | Mio. € | - | - |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 liegen; § 28 Abs. 1 Nr. 8 | Mio. € | - | - |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 liegen; § 28 Abs. 1 Nr. 8 | Mio. € | - | - |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse; § 28 Abs. 1 Nr. 9 | % | 82,7 | 83,6 |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. €; § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite) | CAD | - | - |
| | CHF | - | - |
| | CZK | - | - |
| | DKK | - | - |
| | GBP | - | - |
| | HKD | - | - |
| | JPY | - | - |
| | NOK | - | - |
| | SEK | - | - |
| | USD | - | - |
| AUD | - | - | |
| volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning); § 28 Abs. 1 Nr. 11 | Jahre | 7,7 | 8,4 |
| durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf; § 28 Abs. 2 Nr. 3 | % | 60,0 | 60,0 |

| Öffentliche Pfandbriefe | | Q2 2017 | Q2 2016 |
|---|--------|---------|---------|
| Umlaufende Pfandbriefe | Mio. € | 2.974,8 | 3.335,1 |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe; § 28 Abs. 1 Nr. 9 | % | 90,4 | 90,0 |
| Deckungsmasse | Mio. € | 3.248,6 | 3.619,7 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 liegen; § 28 Abs. 1 Nr. 8 | Mio. € | - | - |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse; § 28 Abs. 1 Nr. 9 | % | 95,8 | 94,5 |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. €; § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite) | CAD | - | - |
| | CHF | - | - |
| | CZK | - | - |
| | DKK | - | - |
| | GBP | - | - |
| | HKD | - | - |
| | JPY | - | - |
| | NOK | - | - |
| | SEK | - | - |
| | USD | - | - |
| AUD | - | - | |

| Schiffspfandbriefe | | Q2 2017 | Q2 2016 |
|---|--------|---------|---------|
| Umlaufende Pfandbriefe | Mio. € | 79,1 | 165,6 |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe; § 28 Abs. 1 Nr. 9 | % | 87,4 | 94,0 |
| Deckungsmasse | Mio. € | 131,5 | 239,7 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 26 Abs. 1 Nr. 3 liegen; § 28 Abs. 1 Nr. 8 | Mio. € | 7,2 | 1,9 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 26 Abs. 1 Nr. 4 liegen; § 28 Abs. 1 Nr. 8 | Mio. € | - | - |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse; § 28 Abs. 1 Nr. 9 | % | 2,9 | 13,8 |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. €; § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite) | CAD | - | - |
| | CHF | - | 0,4 |
| | CZK | - | - |
| | DKK | - | - |
| | GBP | - | - |
| | HKD | - | - |
| | JPY | - | - |
| | NOK | - | - |
| | SEK | - | - |
| | USD | 95,8 | 143,4 |
| AUD | - | - | |