



DVB Bank SE

Platz der Republik 6
 60325 Frankfurt am Main
 Telefon: +49 69 9750-40
 Telefax: +49 69 9750-4444
 E-Mail: info@dvbbank.com
 Internet: www.dvbbank.com

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

4. Quartal 2020

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q4 2020	Q4 2019	Q4 2020	Q4 2019	Q4 2020	Q4 2019
Schiffspfandbriefe	(Mio. €)	-	500,0	-	501,0	-	500,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	22,5	789,6	23,6	826,5	20,9	782,0
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	22,5	289,6	23,6	325,5	20,9	281,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	57,9	-	65,0	-	56,2
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	22,5	289,6	23,6	325,5		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		-	57,9	-	65,0		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
4. Quartal 2020

Schiffspfandbriefe	Q4 2020		Q4 2019	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	-	1,1	250,0	96,3
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	1,1	250,0	293,0
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	1,1	-	57,8
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	1,1	-	126,3
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	18,1	-	87,1
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	-	-	94,7
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	-	-	23,3
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	-	-	11,1
> 10 Jahre	-	-	-	-

Zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen
4. Quartal 2020

Deckungswerte	Q4 2020 Mio. €	Q4 2019 Mio. €
Bis einschließlich 500 Tsd. €	-	-
Mehr als 500 Tsd. € bis einschließlich 5 Mio. €	-	5,3
Mehr als 5 Mio. €	22,5	519,2
Summe	22,5	524,6

Zur Deckung von Schiffspfandbriefen verwendete Forderungen nach Registerstaaten sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

4. Quartal 2020

Staat	4. 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 2020	22,5	22,5	-	-	-
	Jahr 2019	524,6	524,6	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	11,6	11,6	-	-	-
Bahamas	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	31,9	31,9	-	-	-
Gibraltar	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	7,5	7,5	-	-	-
Griechenland	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	23,0	23,0	-	-	-
Italien	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	9,4	9,4	-	-	-
Kroatien	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	12,0	12,0	-	-	-
Liberia	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	131,0	131,0	-	-	-
Malta	Jahr 2020	22,5	22,5	-	-	-
	Jahr 2019	128,6	128,6	-	-	-
Marshallinseln	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	130,2	130,2	-	-	-
Zypern	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	39,3	39,3	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Schiffspfandbriefe

4. Quartal 2020

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe nach § 26 Abs. 1 Nr.2, Nr.3 und Nr. 4 PfandBG						
Staat	4. Quartal	Summe Mio. €	davon		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4 Mio. €	
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2 Mio. €	Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3 Insgesamt Mio. €		
				davon		
				gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	265,0	-	265,0	-	-
Deutschland	Jahr 2020	-	-	-	-	-
	Jahr 2019	265,0	-	265,0	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

4. Quartal 2020

Schiffspfandbriefe		Q4 2020	Q4 2019
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	-	500,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	22,5	789,6
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach § 26 Abs. 1 Nr. 3 liegen § 28 Abs. 1 Nr. 8	(Mio. €)	-	-
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	%	-	33,6
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro § 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	-	-
	CHF	-	-
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	-	-
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	20,9	512,0
AUD	-	-	