



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
2. Quartal 2020

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q2 2020	Q2 2019	Q2 2020	Q2 2019	Q2 2020	Q2 2019
Schiffspfandbriefe	(Mio. €)	250,0	575,0	250,4	577,3	250,3	576,7
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	657,1	746,5	717,9	789,5	653,8	722,3
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	407,1	171,5	467,5	212,2	403,4	145,6
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		162,8	29,8	186,7	36,8	161,2	25,2
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp- Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	407,1	171,5	467,5	212,2		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		162,8	29,8	186,7	36,8		

* 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
2. Quartal 2020

Schiffspfandbriefe	Q2 2020		Q2 2019	
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €
Restlaufzeit:				
<= 0,5 Jahre	250,0	92,6	75,0	80,6
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	-	52,7	250,0	68,2
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	-	126,2	250,0	99,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	-	51,3	-	128,4
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	-	104,0	-	194,4
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	-	43,3	-	117,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	-	26,9	-	32,3
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	-	160,0	-	26,5
> 10 Jahre	-	-	-	-

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

Deckungswerte	Q2 2020 Mio. €	Q2 2019 Mio. €
Bis einschließlich 500 Tsd. €	-	0,4
Mehr als 500 Tsd. € bis einschließlich 5 Mio. €	3,8	12,5
Mehr als 5 Mio. €	478,3	653,6
Summe	482,1	666,5

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.

2. Quartal 2020

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 2020	482,1	482,1	-	-	-
	Jahr 2019	666,5	666,5	-	-	-
Deutschland	Jahr 2020	9,8	9,8	-		
	Jahr 2019	26,4	26,4	-		
Bahamas	Jahr 2020	29,2	29,2	-		
	Jahr 2019	36,0	36,0	-		
Gibraltar	Jahr 2020	6,8	6,8	-		
	Jahr 2019	9,6	9,6	-		
Griechenland	Jahr 2020	19,7	19,7	-		
	Jahr 2019	31,6	31,6	-		
Italien	Jahr 2020	-	-	-		
	Jahr 2019	11,5	11,5	-		
Kroatien	Jahr 2020	11,3	11,3	-		
	Jahr 2019	12,6	12,6	-		
Liberia	Jahr 2020	123,3	123,3	-		
	Jahr 2019	144,3	144,3	-		
Malta	Jahr 2020	122,2	122,2	-		
	Jahr 2019	171,4	171,4	-		
Marshallinseln	Jahr 2020	122,9	122,9	-		
	Jahr 2019	181,7	181,7	-		
Zypern	Jahr 2020	36,8	36,8	-		
	Jahr 2019	41,4	41,4	-		

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Schiffspfandbriefe

2. Quartal 2020

Weitere Deckungswerte für Schiffspfandbriefe nach § 26 Abs. 1 Nr.2, Nr.3 und Nr. 4 PfandBG						
Staat	2. Quartal	Summe Mio. €	davon		Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 3 Insgesamt Mio. €	Forderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 4 Mio. €
			Ausgleichsforderungen i.S.d. § 26 Abs. 1 Nr. 2 Mio. €	davon gedeckte Schuld- verschreibungen i.S.d. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Mio. €		
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2020	175,0	-	175,0	-	-
	Jahr 2019	80,0	-	80,0	-	-
Deutschland	Jahr 2020	15,0	-	15,0	-	-
	Jahr 2019	80,0	-	80,0	-	-
Frankreich	Jahr 2020	160,0	-	160,0	-	-
	Jahr 2019	-	-	-	-	-

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

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

2. Quartal 2020

Schiffspfandbriefe		Q2 2020	Q2 2019
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	250,0	575,0
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 9	%	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	657,1	746,5
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	%	27,4	11,6
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	451,9	643,2
AUD	-	-	