

Stichtag	III 2009
Referenz	III 2008

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.775,90	680,30	1.929,00	700,37	1.818,74	661,47	2.050,07	742,97
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	2.684,52	1.840,64	2.806,08	1.843,01	2.672,79	1.775,60	2.951,48	1.900,64
Überdeckung in %	51,16%	170,56%	45,47%	163,15%	46,96%	168,43%	43,97%	155,82%

	Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs		Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	
	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008
unter 1 Jahr	75,00	0,00	319,76	257,91
1 Jahr bis zu 2 Jahren	47,00	632,00**	367,52	830,92**
2 Jahre bis zu 3 Jahren	45,00		323,68	
3 Jahre bis zu 4 Jahren	660,00		322,25	
4 Jahre bis zu 5 Jahren	237,00		323,30	
5 Jahre bis zu 10 Jahren	711,90	38,30	790,98	616,95
ab 10 Jahre	0,00	10,00	237,03	134,85

*) Die Berechnung des Risikobarwertes erfolgt auf Basis des dynamischen Verfahrens gem. PfandBarwertV.

***) Laufzeitband 1 Jahr < x ≤ 5 Jahre

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (klassische Deckung)	III 2009	III 2008	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2009	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2008
nach Größenklassen				
x < 300 T€	2.481,74	1.750,37		
300 T€ < x < 5 Mio.€	22,79	9,27		
x > 5 Mio.€	0,00	0,00		
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				
wohnwirtschaftlich	2.489,08	1.759,64		
gewerblich	15,44	0,00		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				
Wohnungen	512,53	303,08	19,09%	16,47%
Einfamilienhäuser	1.439,21	1.086,01	53,61%	59,00%
Mehrfamilienhäuser	537,34	370,54	20,02%	20,13%
Bürogebäude	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Handelsgebäude	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Industriegebäude	0,00	0,00	0,00%	0,00%
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	15,44	0,00	0,58%	0,00%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten sowie Bauplätze	0,00	0,00	0,00%	0,00%
davon Bauplätze	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.				
Gesamtbetrag der sichernden Überdeckung	180,00	81,00	6,71%	4,40%

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2009	III 2008
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00