

Stichtag	I 2010
Referenz	I 2009

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.775,90	1.445,30	1.950,33	1.587,01	1.869,25	1.495,19	2.037,38	1.687,81
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	2.765,74	2.190,71	2.908,36	2.309,65	2.798,51	2.217,50	3.025,98	2.406,82
Überdeckung in %	55,74%	51,57%	49,12%	45,53%	49,71%	48,31%	48,52%	42,60%

	Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs		Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	
	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009
unter 1 Jahr	75,00	0,00	397,50	231,72
1 Jahr bis zu 2 Jahren	62,00	75,00	391,61	217,62
2 Jahre bis zu 3 Jahren	180,00	62,00	293,97	291,38
3 Jahre bis zu 4 Jahren	717,00	175,00	367,61	301,77
4 Jahre bis zu 5 Jahren	168,50	577,00	300,86	274,33
5 Jahre bis zu 10 Jahren	573,40	551,30	754,30	687,87
ab 10 Jahre	0,00	5,00	259,90	185,03

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivatgeschäfte.

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

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (klassische Deckung)	I 2010	I 2009	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse IV 2009	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse IV 2008
nach Größenklassen				
x < 300 T€	2.484,88	2.015,70		
300 T€ < x < 5 Mio.€	100,86	13,02		
x > 5 Mio.€	0,00	0		
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				
wohnwirtschaftlich	2535,26	2.028,71		
gewerblich	50,48	0		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				
Wohnungen	544,57	361,05	19,69%	16,48%
Einfamilienhäuser	1.417,29	1.248,58	51,24%	56,99%
Mehrfamilienhäuser	573,39	419,09	20,73%	19,13%
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	50,48	0,00	1,83%	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	162,00	6,51%	7,39%

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2010	I 2009
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00