

Stichtag	I 2011
Referenz	I 2010

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag (Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.725,90	1.775,90	1.838,14	1.950,33	1.753,23	1.869,25	1.930,99	2.037,38
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	2.793,71	2.765,74	2.869,76	2.908,36	2.724,06	2.798,51	3.028,55	3.025,98
davon gattungsklassische	2.631,71	2.585,74	2.706,25	2.726,07	2.561,25		2.864,36	
davon sonstige Deckungswerte	162,00	180,00	163,51	182,29	162,80		164,19	
Überdeckung in %	61,87%	55,74%	56,12%	49,12%	55,37%	49,71%	56,84%	48,52%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			8,90%					

II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2011		Laufzeitstruktur I 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2011	I 2010
≤ 1 Jahr	409,77	62,00	397,50	75,00	347,77	322,50
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	291,82	180,00	391,61	62,00	111,82	329,61
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	358,97	717,00	293,97	180,00	-358,03	113,97
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	320,32	168,50	367,61	717,00	151,82	-349,39
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	326,85	45,00	300,86	168,50	281,85	132,36
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	810,86	553,40	754,30	573,40	257,46	180,90
> 10 Jahre	275,11	0,00	259,90	0,00	275,11	259,90

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	I 2011	I 2010
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.458,67	2.484,88
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	173,04	100,86
mehr als 5 Mio.€	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	I 2011	I 2010
wohnwirtschaftlich	2.571,35	2.535,26
gewerblich	60,36	50,48

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	I 2011	I 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2010
Wohnungen	607,67	544,57	21,75%	19,69%
Einfamilienhäuser	1.370,52	1.417,29	49,06%	51,24%
Mehrfamilienhäuser	593,15	573,39	21,23%	20,73%
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	60,36	50,48	2,16%	1,83%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%	0,00%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	I 2011	I 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2010
sonstige Deckungswerte	162,00	180,00	9,39%	10,14%
weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%	0,00%
davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	162,00	180,00	9,39%	10,14%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	2.793,71	2.765,74	161,87%	155,74%

IV) Übersicht über rückständige Forderungen (Angaben in Mio. Euro)

	I 2011	I 2010
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00