

Stichtag	I 2012
Referenz	I 2011

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 2012	I 2011	I 2012	I 2011	I 2012	I 2011	I 2012	I 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.673,90	1.725,90	1.842,72	1.838,14	1.787,28	1.753,23	1.901,73	1.930,99
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	2.890,56	2.793,71	3.144,16	2.869,76	3.013,82	2.724,06	3.289,47	3.028,55
davon gattungsklassische	2.728,56	2.631,71	2.976,06	2.706,25	2.851,70	2.561,25	3.114,71	2.864,36
davon sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	168,10	163,51	162,11	162,80	174,76	164,19
Überdeckung in %	72,68%	61,87%	70,63%	56,12%	68,63%	55,37%	72,97%	56,84%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			9,12%					

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

	Laufzeitstruktur I 2012		Laufzeitstruktur I 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2012	I 2011
≤ 1 Jahr	291,47	180,00	409,77	62,00	111,47	347,77
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	341,16	717,00	291,82	180,00	-375,84	111,82
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	320,16	168,50	358,97	717,00	151,66	-358,03
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	396,48	45,00	320,32	168,50	351,48	151,82
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	217,01	10,00	326,85	45,00	207,01	281,85
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1062,14	553,40	810,86	553,40	508,74	257,46
> 10 Jahre	262,14	0,00	275,11	0,00	262,14	275,11

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 (gattungsklassische Deckung)	I 2012	I 2011
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.514,57	2.458,67
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	195,41	173,04
mehr als 5 Mio.€	18,58	0,00

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	I 2012	I 2011
wohnwirtschaftlich	2.573,46	2.571,35
gewerblich	155,10	60,36

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	I 2012	I 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2011
Wohnungen	665,47	607,67	23,02%	21,76%
Einfamilienhäuser	1.505,46	1.370,52	52,08%	49,35%
Mehrfamilienhäuser	402,53	593,15	13,93%	21,39%
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	155,10	60,36	5,37%	2,16%
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 2012	I 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2011
sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	9,68%	9,39%
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	162,00	9,68%	9,39%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	2.890,56	2.793,71	172,68%	161,87%

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

	I 2012	I 2011
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00