

Stichtag	III 2011
Referenz	III 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)	
	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.678,90	1.725,90	1.840,82	1.920,86	1.778,85	1.844,04	1.907,05	2.003,27
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	2.542,21	3.327,51	2.724,98	3.567,76	2.622,51	3.423,31	2.839,03	3.723,57
davon gattungsklassische	2.380,21	3.165,51	2.560,59	3.401,99	2.458,39	3.258,64	2.674,33	3.556,70
davon sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	164,39	165,77	164,11	164,67	164,69	166,87
Überdeckung in %	51,42%	92,80%	48,03%	85,74%	47,43%	85,64%	48,87%	85,87%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			8,93%					

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

	Laufzeitstruktur III 2011		Laufzeitstruktur III 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2011	III 2010
≤ 1 Jahr	327,72	45,00	425,06	47,00	282,72	378,06
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	293,35	660,00	409,00	45,00	-366,65	364,00
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	299,27	237,00	384,89	660,00	62,27	-275,11
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	364,75	173,50	404,32	237,00	191,25	167,32
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	208,75	10,00	350,19	173,50	198,75	176,69
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	812,07	553,40	997,23	563,40	258,67	433,83
> 10 Jahre	236,30	0,00	356,81	0,00	236,30	356,81

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	III 2011	III 2010
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.255,94	2.948,51
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	124,27	217,01
mehr als 5 Mio.€	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	III 2011	III 2010
wohnwirtschaftlich	2.304,17	3.079,73
gewerblich	76,04	85,78

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2011	III 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs III 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs III 2010
sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	9,65%	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	180,00	9,65%	10,14%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	2.542,21	3.327,51	151,42%	192,80%

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	III 2011	III 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2010
Wohnungen	588,64	714,48	23,15%	21,47%
Einfamilienhäuser	1.359,73	1.613,03	53,49%	48,48%
Mehrfamilienhäuser	355,81	752,22	14,00%	22,61%
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	76,04	85,78	2,99%	2,58%
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.

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

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