

Stichtag	IV 2013
Referenz	IV 2012

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)	
	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumsaufs	1.143,90	1.643,90	1.260,83	1.828,47	1.209,01	1.783,96	1.313,93	1.865,63
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	3.191,65	3.446,44	3.466,12	3.802,73	3.305,25	3.656,11	3.630,12	3.939,07
davon gattungsklassische	2.975,65	2.794,59	3.233,76	3.127,03	3.081,89	2.990,85	3.388,05	3.253,05
davon sonstige Deckungswerte	216,00	651,85	232,35	675,70	223,36	665,26	242,07	686,02
Überdeckung in %	179,01%	109,65%	174,91%	107,97%	173,39%	104,94%	176,28%	111,14%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			18,43%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2013		Laufzeitstruktur IV 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2013	IV 2012
≤ 1 Jahr	352,79	107,00	374,07	790,00	245,79	-415,93
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	443,11	183,50	334,07	107,00	259,61	227,07
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	283,82	38,00	851,29	183,50	245,82	667,79
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	274,57	70,00	244,95	10,00	204,57	234,95
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	290,24	125,80	219,06	45,00	164,44	174,06
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1275,45	619,60	1176,51	508,40	655,85	668,11
> 10 Jahre	271,68	0,00	246,49	0,00	271,68	246,49

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

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)	IV 2013	IV 2012		
nach Größenklassen				
bis einschließlich 300 T€	2.583,49	2.500,73		
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	358,70	258,37		
mehr als 5 Mio.€	33,46	35,49		
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				
wohnwirtschaftlich	2.615,64	2.549,72		
gewerblich	360,01	244,87		
nach Nutzungsart (II) in Deutschland			Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse IV 2013	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse IV 2012
Wohnungen	691,40	661,53	21,66%	19,19%
Einfamilienhäuser	1.520,60	1499,60	47,64%	43,51%
Mehrfamilienhäuser	403,65	388,59	12,65%	11,28%
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	360,01	244,87	11,28%	7,10%
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2013	IV 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumsaufs IV 2013	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumsaufs IV 2012
sonstige Deckungswerte	216,00	651,85	18,88%	39,65%
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)	216,00	647,10	18,88%	39,36%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	4,75	0,00%	0,29%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	3.191,65	3.446,44	279,01%	209,65%

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2013	IV 2012
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00

V) Anhang des Jahresabschlusses

(Angaben in Mio. Euro)

	wohnwirtschaftlich		gewerblich	
	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012
Anzahl der am Abschlusstag anhängigen Zwangsversteigerungs- und Zwangsverwaltungsverfahren	0,00	0,00	0,00	0,00
Anzahl der im Geschäftsjahr durchgeführten Zwangsversteigerungen	0,00	0,00	0,00	0,00
Anzahl der im Geschäftsjahr zur Verhütung von Verlusten übernommenen Grundstücke	0,00	0,00	0,00	0,00
Gesamtbetrag der rückständigen Zinsen	0,00	0,00	0,00	0,00