

Stichtag	II 2011
Referenz	II 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)	
	II 2011	II 2010	II 2011	II 2010	II 2011	II 2010	II 2011	II 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.725,90	1.800,90	1.833,69	1.982,42	1.761,60	1.902,19	1.911,55	2.068,52
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	2.864,87	3.142,16	2.965,41	3.343,56	2.829,06	3.209,87	3.112,62	3.487,32
davon gattungsklassische	2.702,87	2.962,16	2.801,61	3.179,76	2.665,81		2.948,31	
davon sonstige Deckungswerte	162,00	180,00	163,80	163,80	163,25		164,31	
Überdeckung in %	65,99%	74,48%	61,72%	68,66%	60,60%	68,75%	62,83%	68,59%
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 II 2011		Laufzeitstruktur II 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2011	II 2010
≤ 1 Jahr	418,90	67,00	416,72	75,00	351,90	341,72
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	317,86	685,00	398,24	67,00	-367,14	331,24
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	365,34	237,00	332,29	685,00	128,34	-352,71
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	367,21	173,50	401,36	237,00	193,71	164,36
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	259,79	10,00	326,81	173,50	249,79	153,31
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	869,60	553,40	933,08	563,40	316,20	369,68
> 10 Jahre	266,16	0,00	333,66	0,00	266,16	333,66

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	II 2011	II 2010
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.520,69	2.796,97
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	182,18	165,19
mehr als 5 Mio.€	0,00	0,00

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	II 2011	II 2010
wohnwirtschaftlich	2.602,24	2.889,62
gewerblich	100,63	72,54

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	II 2011	II 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs II 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs II 2010
sonstige Deckungswerte	162,00	180,00	9,39%	10,00%
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	2.864,87	3.142,16	165,99%	174,48%

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	II 2011	II 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse II 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse II 2010
Wohnungen	635,81	677,08	22,19%	21,55%
Einfamilienhäuser	1.466,07	1.528,53	51,17%	48,65%
Mehrfamilienhäuser	500,35	684,01	17,47%	21,77%
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	100,63	72,54	3,51%	2,31%
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)

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