

Stichtag	I 2013
Referenz	I 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)	
	I 2013	I 2012	I 2013	I 2012	I 2013	I 2012	I 2013	I 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.493,90	1.673,90	1.650,85	1.842,72	1.610,78	1.787,28	1.687,15	1.901,73
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	3.498,25	2.890,56	3.827,33	3.144,16	3.684,97	3.013,82	3.964,70	3.289,47
davon gattungsklassische	2.846,40	2.728,56	3.155,78	2.976,06	3.023,16	2.851,70	3.283,20	3.114,71
davon sonstige Deckungswerte	651,85	162,00	671,55	168,10	661,81	162,11	681,49	174,76
Überdeckung in %	134,17%	72,68%	131,84%	70,63%	128,77%	68,63%	134,99%	72,97%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			40,39%					

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

	Laufzeitstruktur I 2013		Laufzeitstruktur I 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2013	I 2012
≤ 1 Jahr	407,16	717,00	291,47	180,00	-309,84	111,47
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	346,52	168,50	341,16	717,00	178,02	-375,84
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	859,25	45,00	320,16	168,50	814,25	151,66
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	250,73	10,00	396,48	45,00	240,73	351,48
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	248,38	45,00	217,01	10,00	203,38	207,01
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1167,41	508,40	1062,14	553,40	659,01	508,74
> 10 Jahre	218,80	0,00	262,14	0,00	218,80	262,14

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 2013	I 2012
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.526,13	2.514,57
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	278,58	195,41
mehr als 5 Mio.€	41,69	18,58

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	I 2013	I 2012
wohnwirtschaftlich	2.572,53	2.573,46
gewerblich	273,86	155,10

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	I 2013	I 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2013	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse I 2012
Wohnungen	659,60	665,47	18,86%	23,02%
Einfamilienhäuser	1.503,93	1505,46	42,99%	52,08%
Mehrfamilienhäuser	409,00	402,53	11,69%	13,93%
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	273,86	155,10	7,83%	5,37%
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 2013	I 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2013	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs I 2012
sonstige Deckungswerte	651,85	162,00	43,63%	9,68%
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)	647,10	162,00	43,32%	9,68%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	4,75	0,00	0,32%	0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	3.498,25	2.890,56	234,17%	172,68%

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

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