

Stichtag	III 2013
Referenz	III 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)	
	III 2013	III 2012	III 2013	III 2012	III 2013	III 2012	III 2013	III 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.273,90	1.658,90	1.395,17	1.838,61	1.341,48	1.790,19	1.449,71	1.882,00
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	3.203,21	2.930,80	3.489,22	3.255,40	3.334,18	3.115,19	3.647,10	3.392,39
davon gattungsklassische	2.942,21	2.768,80	3.211,94	3.083,51	3.065,94	2.948,93	3.360,08	3.214,43
davon sonstige Deckungswerte	261,00	162,00	277,27	171,89	268,24	166,26	287,02	177,96
Überdeckung in %	151,45%	76,67%	150,09%	77,06%	148,55%	74,02%	151,57%	80,25%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			19,87%					

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

	Laufzeitstruktur III 2013		Laufzeitstruktur III 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2013	III 2012
≤ 1 Jahr	367,81	237,00	340,89	675,00	130,81	-334,11
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	484,13	173,50	341,50	237,00	310,63	104,50
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	279,88	10,00	412,95	173,50	269,88	239,45
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	267,47	103,00	255,66	10,00	164,47	245,66
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	275,88	75,30	226,16	50,00	200,58	176,16
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1259,00	675,10	1111,95	513,40	583,90	598,55
> 10 Jahre	269,04	0,00	241,69	0,00	269,04	241,69

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)	III 2013	III 2012	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2013	III 2012	Anteil	
						am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs III 2013	am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs III 2012
nach Größenklassen			sonstige Deckungswerte	261,00	162,00	20,49%	9,77%
bis einschließlich 300 T€	2.570,27	2.508,58	weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	330,56	227,78	davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
mehr als 5 Mio.€	41,38	32,44	davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	0,00	0,00%	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland			Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
wohnwirtschaftlich	2.594,63	2.561,56	Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	261,00	162,00	20,49%	9,77%
gewerblich	347,59	207,24	Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
			Summe gattungsklassische und weitere Deckung	3.203,21	2.930,80	251,45%	176,67%

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	III 2013	III 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2013	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2012
Wohnungen	684,76	662,46	21,38%	22,60%
Einfamilienhäuser	1.507,69	1506,24	47,07%	51,39%
Mehrfamilienhäuser	402,19	392,85	12,56%	13,40%
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	347,59	207,24	10,85%	7,07%
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 2013	III 2012
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00