

Stichtag	III 2012
Referenz	III 2011

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 2012	III 2011	III 2012	III 2011	III 2012	III 2011	III 2012	III 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.658,90	1.678,90	1.838,61	1.840,82	1.790,19	1.778,85	1.882,00	1.907,05
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	2.930,80	2.542,21	3.255,40	2.724,98	3.115,19	2.622,51	3.392,39	2.839,03
davon gattungsklassische	2.768,80	2.380,21	3.083,51	2.560,59	2.948,93	2.458,39	3.214,43	2.674,33
davon sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	171,89	164,39	166,26	164,11	177,96	164,69
Überdeckung in %	76,67%	51,42%	77,06%	48,03%	74,02%	47,43%	80,25%	48,87%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			9,35%					

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

	Laufzeitstruktur III 2012		Laufzeitstruktur III 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2012	III 2011
≤ 1 Jahr	340,89	675,00	327,72	45,00	-334,11	282,72
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	341,50	237,00	293,35	660,00	104,50	-366,65
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	412,95	173,50	299,27	237,00	239,45	62,27
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	255,66	10,00	364,75	173,50	245,66	191,25
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	226,16	50,00	208,75	10,00	176,16	198,75
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1111,95	513,40	812,07	553,40	598,55	258,67
> 10 Jahre	241,69	0,00	236,30	0,00	241,69	236,30

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 2012	III 2011	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2012	III 2011	Anteil	
						am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs III 2012	am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs III 2011
nach Größenklassen			sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	9,77%	9,65%
bis einschließlich 300 T€	2.508,58	2.255,94	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.€	227,78	124,27	davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
mehr als 5 Mio.€	32,44	0,00	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	2.561,56	2.304,17	Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	162,00	162,00	9,77%	9,65%
gewerblich	207,24	76,04	Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland			Summe gattungsklassische und weitere Deckung	2.930,80	2.542,21	176,67%	151,42%
Wohnungen	662,46	588,64					
Einfamilienhäuser	1.506,24	1.359,73					
Mehrfamilienhäuser	392,85	355,81					
Bürogebäude	0,00	0,00					
Handelsgebäude	0,00	0,00					
Industriegebäude	0,00	0,00					
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	207,24	76,04					
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00					
Bauplätze	0,00	0,00					

	III 2012	III 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse III 2011
Wohnungen	662,46	588,64	22,60%	23,15%
Einfamilienhäuser	1.506,24	1.359,73	51,39%	53,49%
Mehrfamilienhäuser	392,85	355,81	13,40%	14,00%
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	207,24	76,04	7,07%	2,99%
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 2012	III 2011
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00