

Stichtag	II 2012
Referenz	II 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)	
	II 2012	II 2011	II 2012	II 2011	II 2012	II 2011	II 2012	II 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.668,90	1.725,90	1.826,69	1.833,69	1.775,23	1.761,60	1.880,42	1.911,55
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	2.913,89	2.864,87	3.196,52	2.965,41	3.056,66	2.829,06	3.347,28	3.112,62
davon gattungsklassische	2.751,89	2.702,87	3.026,20	2.801,61	2.892,15	2.665,81	3.170,59	2.948,31
davon sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	170,32	163,80	164,51	163,25	176,69	164,31
Überdeckung in %	74,60%	65,99%	74,99%	61,72%	72,18%	60,60%	78,01%	62,83%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			9,32%					

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

	Laufzeitstruktur II 2012		Laufzeitstruktur II 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2012	II 2011
≤ 1 Jahr	331,05	685,00	418,90	67,00	-353,95	351,90
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	348,34	237,00	317,86	685,00	111,34	-367,14
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	409,36	173,50	365,34	237,00	235,86	128,34
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	280,90	10,00	367,21	173,50	270,90	193,71
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	222,48	40,00	259,79	10,00	182,48	249,79
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1084,43	523,40	869,60	553,40	561,03	316,20
> 10 Jahre	237,33	0,00	266,16	0,00	237,33	266,16

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)	II 2012	II 2011
nach Größenklassen		
bis einschließlich 300 T€	2.507,23	2.520,69
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	218,87	182,18
mehr als 5 Mio.€	25,79	0,00

nach Nutzungsart (I) in Deutschland	II 2012	II 2011
wohnwirtschaftlich	2.564,87	2.602,24
gewerblich	187,02	100,63

nach Nutzungsart (II) in Deutschland	II 2012	II 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse II 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse II 2011
Wohnungen	664,17	635,81	22,79%	22,19%
Einfamilienhäuser	1.511,67	1.466,07	51,88%	51,17%
Mehrfamilienhäuser	389,03	500,35	13,35%	17,47%
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	187,02	100,63	6,42%	3,51%
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)	II 2012	II 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs II 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs II 2011
sonstige Deckungswerte	162,00	162,00	9,71%	9,39%
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	162,00	9,71%	9,39%
Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
Summe gattungsklassische und weitere Deckung	2.913,89	2.864,87	174,60%	165,99%

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

	II 2012	II 2011
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00