

Stichtag	II 2013
Referenz	II 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)	
	II 2013	II 2012	II 2013	II 2012	II 2013	II 2012	II 2013	II 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	1.086,90	1.668,90	1.204,19	1.826,69	1.157,66	1.775,23	1.250,66	1.880,42
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	3.140,08	2.913,89	3.429,51	3.196,52	3.273,51	3.056,66	3.589,40	3.347,28
davon gattungsklassische	2.879,08	2.751,89	3.152,11	3.026,20	3.005,63	2.892,15	3.301,67	3.170,59
davon sonstige Deckungswerte	261,00	162,00	277,40	170,32	267,88	164,51	287,73	176,69
Überdeckung in %	188,90%	74,60%	184,80%	74,99%	182,77%	72,18%	187,00%	78,01%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			23,04%					

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

	Laufzeitstruktur II 2013		Laufzeitstruktur II 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2013	II 2012
≤ 1 Jahr	390,22	237,00	331,05	685,00	153,22	-353,95
1 Jahr < x ≤ 2 Jahre	469,99	173,50	348,34	237,00	296,49	111,34
2 Jahre < x ≤ 3 Jahre	293,37	10,00	409,36	173,50	283,37	235,86
3 Jahre < x ≤ 4 Jahre	248,16	68,00	280,90	10,00	180,16	270,90
4 Jahre < x ≤ 5 Jahre	258,92	22,00	222,48	40,00	236,92	182,48
5 Jahre < x ≤ 10 Jahre	1220,78	576,40	1084,43	523,40	644,38	561,03
> 10 Jahre	258,64	0,00	237,33	0,00	258,64	237,33

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 2013	II 2012	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	II 2013	II 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs II 2013	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs II 2012
nach Größenklassen			sonstige Deckungswerte	261,00	162,00	24,01%	9,71%
bis einschließlich 300 T€	2.539,65	2.507,23	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.€	297,91	218,87	davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%	0,00%
mehr als 5 Mio.€	41,53	25,79	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	2.575,94	2.564,87	Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	261,00	162,00	24,01%	9,71%
gewerblich	303,14	187,02	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	3.140,08	2.913,89	288,90%	174,60%
Wohnungen	677,54	664,17					
Einfamilienhäuser	1.494,15	1.511,67					
Mehrfamilienhäuser	404,25	389,03					
Bürogebäude	0,00	0,00					
Handelsgebäude	0,00	0,00					
Industriegebäude	0,00	0,00					
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	303,14	187,02					
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00					
Bauplätze	0,00	0,00					

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

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

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