

Stichtag	I 2011
Referenz	I 2010

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 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	40,00	-	37,96	-	28,65	-	51,70	-
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	62,81	-	65,43	-	55,47	-	78,11	-
davon gattungsklassische	57,81	-	60,25	-	50,72	-	72,46	-
davon sonstige Deckungswerte	5,00	-	5,17	-	4,74	-	5,65	-
Überdeckung in %	57,04%	-	72,36%	-	93,61%	-	51,08%	-
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			13,63%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2011		Laufzeitstruktur I 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2011	I 2010
unter 1 Jahr	1,47	0,00	-	-	1,47	-
1 Jahr bis zu 2 Jahren	1,22	0,00	-	-	1,22	-
2 Jahre bis zu 3 Jahren	1,17	0,00	-	-	1,17	-
3 Jahre bis zu 4 Jahren	7,86	0,00	-	-	7,86	-
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2,93	0,00	-	-	2,93	-
5 Jahre bis zu 10 Jahren	35,02	10,00	-	-	25,02	-
ab 10 Jahre	13,15	30,00	-	-	-16,85	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statisches Verfahren 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	I 2011	I 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	I 2011	I 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	5,00	-	12,50%
bis einschließlich 300 T€	56,61	-		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	-	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	1,20	-		davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	0,00	-	0,00%
mehr als 5 Mio.€	0,00	-		davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	-	0,00%
				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	-	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	5,00	-	12,50%
wohnwirtschaftlich	57,81	-		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	-	0,00%
gewerblich	0,00	-					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	62,81	-	157,04%
Wohnungen	10,98	-	17,48%				
Einfamilienhäuser	40,83	-	65,01%				
Mehrfamilienhäuser	6,00	-	9,55%				
Bürogebäude	0,00	-	0,00%				
Handelsgebäude	0,00	-	0,00%				
Industriegebäude	0,00	-	0,00%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0,00	-	0,00%				
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)

	I 2011	I 2010
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	-