

Stichtag	II 2011
Referenz	II 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)	
	II 2011	II 2010	II 2011	II 2010	II 2011	II 2010	II 2011	II 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	55,00	-	54,45	-	42,53	-	71,46	-
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	79,80	-	84,30	-	71,31	-	100,84	-
davon gattungsklassische	74,80	-	79,03	-	66,45	-	95,13	-
davon sonstige Deckungswerte	5,00	-	5,27	-	4,86	-	5,71	-
Überdeckung in %	45,10%	-	54,83%	-	67,67%	-	41,12%	-
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			9,68%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur II 2011		Laufzeitstruktur II 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2011	II 2010
unter 1 Jahr	1,79	0,00	-	-	1,79	-
1 Jahr bis zu 2 Jahren	1,53	0,00	-	-	1,53	-
2 Jahre bis zu 3 Jahren	1,62	0,00	-	-	1,62	-
3 Jahre bis zu 4 Jahren	9,17	0,00	-	-	9,17	-
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2,85	5,00	-	-	-2,15	-
5 Jahre bis zu 10 Jahren	45,23	20,00	-	-	25,23	-
ab 10 Jahre	17,62	30,00	-	-	-12,38	-

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	II 2011	II 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	II 2011	II 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	73,27	-		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2- 3 PfandBG brutto	0,00	-	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	1,53	-		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	-	0,00%
mehr als 5 Mio.€	0,00	-		davon höchste Geldforderung geg. Kl	0,00	-	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG			
wohnwirtschaftlich	74,80	-		Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	5,00	-	9,09%
gewerblich	0,00	-		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	-	0,00%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung			
Wohnungen	13,57	-	17,00%		79,80	-	145,10%
Einfamilienhäuser	53,95	-	67,60%				
Mehrfamilienhäuser	7,29	-	9,13%				
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)

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