

Stichtag	IV 2012
Referenz	IV 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)	
	IV 2012	IV 2011	IV 2012	IV 2011	IV 2012	IV 2011	IV 2012	IV 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	170,00	95,00	190,44	104,43	157,89	82,74	213,78	132,29
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	231,92	119,67	273,17	135,95	232,43	114,96	299,91	159,29
davon gattungsklassische	216,92	114,67	257,03	130,45	217,54	109,82	283,47	153,57
davon sonstige Deckungswerte	15,00	5,00	16,13	5,51	14,89	5,14	16,43	5,72
Überdeckung in %	36,43%	25,97%	43,44%	30,19%	47,21%	38,94%	40,29%	20,42%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			8,47%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2012		Laufzeitstruktur IV 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2012	IV 2011
bis einschließlich 1 Jahr	6,05	0,00	3,04	0,00	6,05	3,04
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	7,63	0,00	2,68	0,00	7,63	2,68
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	17,87	0,00	3,70	0,00	17,87	3,70
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	10,49	5,00	10,13	0,00	5,49	10,13
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	17,21	30,00	5,64	5,00	-12,79	0,64
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	122,46	105,00	68,93	60,00	17,46	8,93
über 10 Jahre	50,22	30,00	25,55	30,00	20,22	-4,45

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) statischen Verfahren gemäß PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	IV 2012	IV 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2012	IV 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	15,00	5,00	8,82%
bis einschließlich 300 T€	205,82	111,47		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	11,11	3,21		davon nach § 19 I Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
mehr als 5 Mio.€	0,00	0,00		davon höchste Geldforderung geg. Kl	0,00	0,00	0,00%
				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	15,00	5,00	8,82%
wohnwirtschaftlich	216,92	114,67		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	0,00	0,00					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	231,92	119,67	136,43%
Wohnungen	37,69	19,83	16,25%				
Einfamilienhäuser	144,94	80,95	62,49%				
Mehrfamilienhäuser	34,30	13,90	14,79%				
Bürogebäude	0,00	0,00	0,00%				
Handelsgebäude	0,00	0,00	0,00%				
Industriegebäude	0,00	0,00	0,00%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0,00	0,00	0,00%				
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	0,00	0,00	0,00%				
Bauplätze	0,00	0,00	0,00%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

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