

Stichtag	IV 2013
Referenz	IV 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)	
	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	250,00	170,00	263,92	190,44	221,96	157,89	303,48	213,78
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	360,26	231,92	402,65	273,17	346,00	232,43	453,66	299,91
davon gattungsklassische	345,26	216,92	386,85	257,03	331,08	217,54	437,60	283,47
davon sonstige Deckungswerte	15,00	15,00	15,80	16,13	14,92	14,89	16,06	16,43
Überdeckung in %	44,11%	36,43%	52,56%	43,44%	55,89%	47,21%	49,49%	40,29%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,99%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2013		Laufzeitstruktur IV 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2013	IV 2012
bis einschließlich 1 Jahr	14,21	0,00	6,05	0,00	14,21	6,05
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	22,30	0,00	7,63	0,00	22,30	7,63
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	16,53	5,00	17,87	0,00	11,53	17,87
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	22,66	30,00	10,49	5,00	-7,34	5,49
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	17,05	30,00	17,21	30,00	-12,95	-12,79
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	191,00	145,00	122,46	105,00	46,00	17,46
über 10 Jahre	76,52	40,00	50,22	30,00	36,52	20,22

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 2013	IV 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2013	IV 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	15,00	15,00	6,00%
bis einschließlich 300 T€	308,92	205,82		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	36,34	11,11		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	15,00	6,00%
wohnwirtschaftlich	319,56	216,92		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	25,71	0,00		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	360,26	231,92	144,11%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Wohnungen	53,45	37,69	14,84%				
Einfamilienhäuser	206,43	144,94	57,30%				
Mehrfamilienhäuser	59,63	34,30	16,55%				
Bürogebäude	2,80	0,00	0,78%				
Handelsgebäude	2,19	0,00	0,61%				
Industriegebäude	16,44	0,00	4,56%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	4,33	0,00	1,20%				
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 2013	IV 2012
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00