

Stichtag	III 2013
Referenz	III 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)	
	III 2013	III 2012	III 2013	III 2012	III 2013	III 2012	III 2013	III 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	235,00	150,00	250,57	169,25	210,32	139,03	287,90	195,01
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	335,89	197,86	378,35	231,70	324,22	196,97	426,00	257,59
davon gattungsklassische	320,89	182,86	362,60	215,69	309,43	182,28	409,94	241,16
davon sonstige Deckungswerte	15,00	15,00	15,75	16,01	14,78	14,69	16,06	16,43
Überdeckung in %	42,93%	31,91%	50,99%	36,90%	54,16%	41,68%	47,97%	32,09%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			6,28%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2013		Laufzeitstruktur III 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2013	III 2012
bis einschließlich 1 Jahr	11,44	0,00	4,94	0,00	11,44	4,94
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	19,02	0,00	5,85	0,00	19,02	5,85
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	17,73	5,00	13,87	0,00	12,73	13,87
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	22,41	30,00	9,83	5,00	-7,59	4,83
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	14,88	25,00	15,68	30,00	-10,12	-14,32
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	177,19	135,00	107,25	85,00	42,19	22,25
über 10 Jahre	73,22	40,00	40,43	30,00	33,22	10,43

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	III 2013	III 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2013	III 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	15,00	15,00	6,38%
bis einschließlich 300 T€	285,11	176,55		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	35,78	6,31		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	6,38%
wohnwirtschaftlich	295,95	182,86		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	24,94	0,00		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	335,89	197,86	142,93%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Wohnungen	50,18	31,74	14,94%				
Einfamilienhäuser	191,50	126,44	57,01%				
Mehrfamilienhäuser	54,23	24,68	16,14%				
Bürogebäude	2,42	0,00	0,72%				
Handelsgebäude	2,84	0,00	0,84%				
Industriegebäude	15,82	0,00	4,71%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	3,91	0,00	1,16%				
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)

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