

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 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	70,00	-	77,10	-	60,59	-	99,77	-
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	99,99	-	112,36	-	94,94	-	133,10	-
davon gattungsklassische	94,99	-	106,92	-	89,89	-	127,38	-
davon sonstige Deckungswerte	5,00	-	5,44	-	5,05	-	5,72	-
Überdeckung in %	42,84%	-	45,73%	-	56,68%	-	33,41%	-
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,06%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2011		Laufzeitstruktur III 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2011	III 2010
unter 1 Jahr	2,56	0,00	-	-	2,56	-
1 Jahr bis zu 2 Jahren	2,25	0,00	-	-	2,25	-
2 Jahre bis zu 3 Jahren	2,24	0,00	-	-	2,24	-
3 Jahre bis zu 4 Jahren	9,92	0,00	-	-	9,92	-
4 Jahre bis zu 5 Jahren	4,30	5,00	-	-	-0,70	-
5 Jahre bis zu 10 Jahren	56,99	20,00	-	-	36,99	-
ab 10 Jahre	21,74	45,00	-	-	-23,26	-

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	III 2011	III 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2011	III 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	93,47	-		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	-	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	1,52	-		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	94,99	-		Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	5,00	-	7,14%
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	16,57	-	16,57%		99,99	-	142,84%
Einfamilienhäuser	69,02	-	69,02%				
Mehrfamilienhäuser	9,41	-	9,41%				
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)

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