

Stichtag	I 2012
Referenz	I 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)	
	I 2012	I 2011	I 2012	I 2011	I 2012	I 2011	I 2012	I 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	105,00	40,00	116,04	37,96	92,45	28,65	144,89	51,70
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	141,10	62,81	160,76	65,43	136,20	55,47	186,49	78,11
davon gattungsklassische	136,10	57,81	155,39	60,25	131,17	50,72	180,95	72,46
davon sonstige Deckungswerte	5,00	5,00	5,37	5,17	5,03	4,74	5,54	5,65
Überdeckung in %	34,39%	57,04%	38,53%	72,36%	47,33%	93,61%	28,71%	51,08%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			4,63%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2012		Laufzeitstruktur I 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2012	I 2011
unter 1 Jahr	3,56	0,00	1,47	0,00	3,56	1,47
1 Jahr bis zu 2 Jahren	3,67	0,00	1,22	0,00	3,67	1,22
2 Jahre bis zu 3 Jahren	10,08	0,00	1,17	0,00	10,08	1,17
3 Jahre bis zu 4 Jahren	7,48	0,00	7,86	0,00	7,48	7,86
4 Jahre bis zu 5 Jahren	5,41	5,00	2,93	0,00	0,41	2,93
5 Jahre bis zu 10 Jahren	81,21	70,00	35,02	10,00	11,21	25,02
ab 10 Jahre	29,70	30,00	13,15	30,00	-0,30	-16,85

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	I 2012	I 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	I 2012	I 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
<b>nach Größenklassen</b>				<b>sonstige Deckungswerte</b>			
bis einschließlich 300 T€	132,57	56,61		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	3,53	1,20		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. KI	0,00	0,00	0,00%
<b>nach Nutzungsart (I) in Deutschland</b>				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
wohnwirtschaftlich	136,10	57,81		Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	5,00	5,00	4,76%
gewerblich	0,00	0,00		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%
<b>nach Nutzungsart (II) in Deutschland</b>				<b>Summe gattungsklassische und weitere Deckung</b>	<b>141,10</b>	<b>62,81</b>	<b>134,39%</b>
Wohnungen	24,18	10,98	17,13%				
Einfamilienhäuser	95,06	40,83	67,37%				
Mehrfamilienhäuser	16,87	6,00	11,95%				
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 noch 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)

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