

Stichtag	IV 2010
Referenz	IV 2009

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 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	30,00	-	28,69	-	20,77	-	40,86	-
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	45,95	-	49,62	-	42,05	-	59,05	-
davon gattungsklassische	40,95	-	44,18	-	37,08	-	53,04	-
davon sonstige Deckungswerte	5,00	-	5,44	-	4,97	-	5,90	-
Überdeckung in %	53,18%	-	72,93%	-	102,47%	-	44,54%	-
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			18,97%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2010		Laufzeitstruktur IV 2009		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2010	IV 2009
unter 1 Jahr	0,79	0,00	-	-	0,79	-
1 Jahr bis zu 2 Jahren	1,02	0,00	-	-	1,02	-
2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,79	0,00	-	-	0,79	-
3 Jahre bis zu 4 Jahren	1,93	0,00	-	-	1,93	-
4 Jahre bis zu 5 Jahren	7,07	0,00	-	-	7,07	-
5 Jahre bis zu 10 Jahren	26,02	0,00	-	-	26,02	-
ab 10 Jahre	8,34	30,00	-	-	-21,66	-

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	IV 2010	IV 2009	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2010	IV 2009	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	5,00	-	16,67%
bis einschließlich 300 T€	40,13	-		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	-	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	0,82	-		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,00	-	0,00%
mehr als 5 Mio.€	0,00	-		davon höchste Geldforderung geg. KI	0,00	-	0,00%
				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	-	0,00%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	5,00	-	16,67%
wohnwirtschaftlich	40,88	-		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	-	0,00%
gewerblich	0,08	-					
				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	45,95	-	153,18%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Wohnungen	7,72	-	16,79%				
Einfamilienhäuser	28,93	-	62,96%				
Mehrfamilienhäuser	4,23	-	9,20%				
Bürogebäude	0,00	-	0,00%				
Handelsgebäude	0,00	-	0,00%				
Industriegebäude	0,00	-	0,00%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0,08	-	0,17%				
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)

	IV 2010	IV 2009
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	-