

Stichtag	IV 2011
Referenz	IV 2010

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 2011	IV 2010	IV 2011	IV 2010	IV 2011	IV 2010	IV 2011	IV 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	95,00	30,00	104,43	28,69	82,74	20,77	132,29	40,86
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	119,67	45,95	135,95	49,62	114,96	42,05	159,29	59,05
davon gattungsklassische	114,67	40,95	130,45	44,18	109,82	37,08	153,57	53,04
davon sonstige Deckungswerte	5,00	5,00	5,51	5,44	5,14	4,97	5,72	5,90
Überdeckung in %	25,97%	53,18%	30,19%	72,93%	38,94%	102,47%	20,42%	44,54%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,27%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2011		Laufzeitstruktur IV 2010		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2011	IV 2010
unter 1 Jahr	3,04	0,00	0,79	0,00	3,04	0,79
1 Jahr bis zu 2 Jahren	2,68	0,00	1,02	0,00	2,68	1,02
2 Jahre bis zu 3 Jahren	3,70	0,00	0,79	0,00	3,70	0,79
3 Jahre bis zu 4 Jahren	10,13	0,00	1,93	0,00	10,13	1,93
4 Jahre bis zu 5 Jahren	5,64	5,00	7,07	0,00	0,64	7,07
5 Jahre bis zu 10 Jahren	68,93	60,00	26,02	0,00	8,93	26,02
ab 10 Jahre	25,55	30,00	8,34	30,00	-4,45	-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 2011	IV 2010	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	IV 2011	IV 2010	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	5,00	5,00	5,26%
bis einschließlich 300 T€	111,47	40,13		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	3,21	0,82		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)	5,00	5,00	5,26%
wohnwirtschaftlich	114,67	40,88		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	0,00	0,08					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	119,67	45,95	125,97%
Wohnungen	19,83	7,72	16,57%				
Einfamilienhäuser	80,95	28,93	67,64%				
Mehrfamilienhäuser	13,90	4,23	11,61%				
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	0,08	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)

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