

Stichtag	II 2012
Referenz	II 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)	
	II 2012	II 2011	II 2012	II 2011	II 2012	II 2011	II 2012	II 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	125,00	55,00	140,03	54,45	113,79	42,53	166,81	71,46
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	154,74	79,80	179,80	84,30	152,48	71,31	204,42	100,84
davon gattungsklassische	149,74	74,80	174,38	79,03	147,37	66,45	198,88	95,13
davon sonstige Deckungswerte	5,00	5,00	5,42	5,27	5,11	4,86	5,54	5,71
Überdeckung in %	23,79%	45,10%	28,40%	54,83%	34,00%	67,67%	22,55%	41,12%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			3,87%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur II 2012		Laufzeitstruktur II 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2012	II 2011
bis einschließlich 1 Jahr	3,71	0,00	1,79	0,00	3,71	1,79
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	4,57	0,00	1,53	0,00	4,57	1,53
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	11,79	0,00	1,62	0,00	11,79	1,62
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	7,80	5,00	9,17	0,00	2,80	9,17
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	5,31	20,00	2,85	5,00	-14,69	-2,15
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	88,70	70,00	45,23	20,00	18,70	25,23
über 10 Jahre	32,88	30,00	17,62	30,00	2,88	-12,38

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	II 2012	II 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	II 2012	II 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	5,00	5,00	4,00%
bis einschließlich 300 T€	145,41	73,27		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	4,33	1,53		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	4,00%
wohnwirtschaftlich	149,74	74,80		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. Ia PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	0,00	0,00					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	154,74	79,80	123,79%
Wohnungen	26,24	13,57	16,95%				
Einfamilienhäuser	105,14	53,95	67,94%				
Mehrfamilienhäuser	18,37	7,29	11,87%				
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 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)

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