

Stichtag	III 2012
Referenz	III 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)	
	III 2012	III 2011	III 2012	III 2011	III 2012	III 2011	III 2012	III 2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	150,00	70,00	169,25	77,10	139,03	60,59	195,01	99,77
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	197,86	99,99	231,70	112,36	196,97	94,94	257,59	133,10
davon gattungsklassische	182,86	94,99	215,69	106,92	182,28	89,89	241,16	127,38
davon sonstige Deckungswerte	15,00	5,00	16,01	5,44	14,69	5,05	16,43	5,72
Überdeckung in %	31,91%	42,84%	36,90%	45,73%	41,68%	56,68%	32,09%	33,41%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			9,46%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2012		Laufzeitstruktur III 2011		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2012	III 2011
bis einschließlich 1 Jahr	4,94	0,00	2,56	0,00	4,94	2,56
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	5,85	0,00	2,25	0,00	5,85	2,25
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	13,87	0,00	2,24	0,00	13,87	2,24
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	9,83	5,00	9,92	0,00	4,83	9,92
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	15,68	30,00	4,30	5,00	-14,32	-0,70
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	107,25	85,00	56,99	20,00	22,25	36,99
über 10 Jahre	40,43	30,00	21,74	45,00	10,43	-23,26

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	III 2012	III 2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	III 2012	III 2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	15,00	5,00	10,00%
bis einschließlich 300 T€	176,55	93,47		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	6,31	1,52		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%
				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)	15,00	5,00	10,00%
wohnwirtschaftlich	182,86	94,99		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	0,00	0,00					
				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	197,86	99,99	131,91%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Wohnungen	31,74	16,57	16,04%				
Einfamilienhäuser	126,44	69,02	63,90%				
Mehrfamilienhäuser	24,68	9,41	12,47%				
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)

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