

Stichtag	I 2013
Referenz	I 2012

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 2013	I 2012	I 2013	I 2012	I 2013	I 2012	I 2013	I 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	200,00	105,00	220,64	116,04	183,29	92,45	248,46	144,89
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	255,25	141,10	296,81	160,76	252,63	136,20	327,76	186,49
davon gattungsklassische	240,25	136,10	281,08	155,39	238,06	131,17	311,70	180,95
davon sonstige Deckungswerte	15,00	5,00	15,73	5,37	14,57	5,03	16,06	5,54
Überdeckung in %	27,62%	34,39%	34,52%	38,53%	37,83%	47,33%	31,92%	28,71%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			7,13%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2013		Laufzeitstruktur I 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2013	I 2012
bis einschließlich 1 Jahr	7,39	0,00	3,56	0,00	7,39	3,56
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	16,69	0,00	3,67	0,00	16,69	3,67
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	12,01	0,00	10,08	0,00	12,01	10,08
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	20,02	5,00	7,48	0,00	15,02	7,48
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	9,18	30,00	5,41	5,00	-20,82	0,41
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	133,93	135,00	81,21	70,00	-1,07	11,21
über 10 Jahre	56,04	30,00	29,70	30,00	26,04	-0,30

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	I 2013	I 2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	I 2013	I 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	15,00	5,00	7,50%
bis einschließlich 300 T€	225,69	132,57		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	14,55	3,53		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)	15,00	5,00	7,50%
wohnwirtschaftlich	238,14	136,10		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	2,11	0,00		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	255,25	141,10	127,62%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Wohnungen	42,12	24,18	16,50%				
Einfamilienhäuser	158,37	95,06	62,05%				
Mehrfamilienhäuser	37,64	16,87	14,75%				
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	2,11	0,00	0,83%				
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)

	I 2013	I 2012
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00