

Report zum Hypothekendarlehenpfandbriefumlauf

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	30.06.2013
Referenz	30.06.2012

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)	
	30.06.2013	30.06.2012	30.06.2013	30.06.2012	30.06.2013	30.06.2012	30.06.2013	30.06.2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	85,00	40,00	88,23	42,96	71,91	34,82	102,98	50,56
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	122,84	67,01	136,44	74,77	118,00	64,29	150,63	83,33
davon gattungsklassische	112,84	57,01	125,74	64,13	108,64	55,18	139,13	71,59
davon sonstige Deckungswerte	10,00	10,00	10,70	10,64	9,36	9,11	11,50	11,74
Überdeckung in %	44,52%	67,53%	54,64%	74,04%	64,11%	84,64%	46,27%	64,83%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			12,12%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.06.2013	30.06.2012	30.06.2013	30.06.2012	30.06.2013	30.06.2012
bis einschließlich 1 Jahr	5,68	1,86	0,00	0,00	5,68	1,86
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	5,84	2,75	0,00	0,00	5,84	2,75
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	6,67	3,83	0,00	0,00	6,67	3,83
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	5,77	4,22	0,00	0,00	5,77	4,22
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	6,40	2,36	0,00	0,00	6,40	2,36
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	86,18	49,04	85,00	40,00	1,18	9,04
über 10 Jahre	6,30	2,95	0,00	0,00	6,30	2,95

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	30.06.2013	30.06.2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.06.2013	30.06.2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	10,00	10,00	11,76%
bis einschließlich 300 T€	99,73	51,40		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	13,11	5,61		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)	10,00	10,00	11,76%
wohnwirtschaftlich	106,55	52,83		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
gewerblich	6,29	4,19		Summe gattungsklassische und weitere Deckung	122,84	67,01	144,52%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland							
Wohnungen	46,51	24,65	37,86%				
Einfamilienhäuser	46,31	23,32	37,70%				
Mehrfamilienhäuser	13,73	4,86	11,18%				
Bürogebäude	0,55	0,00	0,45%				
Handelsgebäude	0,37	0,52	0,31%				
Industriegebäude	1,79	1,65	1,46%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	3,58	2,02	2,91%				
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)

	30.06.2013	30.06.2012
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00