

Report zum Hypothekendarlehenpfandbriefumlauf

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	30.09.2012
Referenz	30.09.2011

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)	
	30.09.2012	30.09.2011	30.09.2012	30.09.2011	30.09.2012	30.09.2011	30.09.2012	30.09.2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	50,0	10,0	54,2	10,1	43,9	8,1	62,3	12,6
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	81,3	25,0	92,0	27,0	79,1	23,4	100,6	31,3
davon gattungsklassische	71,3	23,0	81,1	24,9	69,7	21,4	88,8	29,1
davon sonstige Deckungswerte	10,0	2,0	10,9	2,1	9,4	2,0	11,7	2,2
Überdeckung in %	62,6%	150,4%	69,7%	167,5%	80,1%	188,4%	61,5%	147,6%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			20,2%	20,7%				

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.09.2012	30.09.2011	30.09.2012	30.09.2011	30.09.2012	30.09.2011
unter 1 Jahr	2,6	1,8	0,0	0,0	2,6	1,8
1 Jahr bis zu 2 Jahren	3,2	3,0	0,0	0,0	3,2	3,0
2 Jahre bis zu 3 Jahren	4,2	0,8	0,0	0,0	4,2	0,8
3 Jahre bis zu 4 Jahren	5,0	0,6	0,0	0,0	5,0	0,6
4 Jahre bis zu 5 Jahren	3,1	2,6	0,0	0,0	3,1	2,6
5 Jahre bis zu 10 Jahren	59,8	15,0	50,0	10,0	9,8	5,0
ab 10 Jahre	3,4	1,4	0,0	0,0	3,4	1,4

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	30.09.2012	30.09.2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.09.2012	30.09.2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
bis einschließlich 300 T€	63,9	23,0		sonstige Deckungswerte			
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	7,4	0,0		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,0	0,0	20,0%
mehr als 5 Mio.€	0,0	0,0		davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG	0,0	0,0	0,0%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				davon höchste Geldforderung geg. KI	0,0	0,0	0,0%
wohnwirtschaftlich	66,0	22,9		Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,0	0,0	0,0%
gewerblich	5,4	0,2		Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	10,0	2,0	20,0%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,0	0,0	0,0%
Wohnungen	31,1	10,7	38,2%	Summe gattungsklassische und weitere Deckung	81,3	25,0	162,6%
Einfamilienhäuser	28,3	10,9	34,8%				
Mehrfamilienhäuser	6,6	1,3	8,1%				
Bürogebäude	0,0	0,0	0,0%				
Handelsgebäude	0,5	0,0	0,6%				
Industriegebäude	1,6	0,0	2,0%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	3,2	0,2	4,0%				
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	0,0	0,0	0,0%				
Bauplätze	0,0	0,0	0,0%				

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	30.09.2012	30.09.2011
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,0	0,0