

Report zum Hypothekendarlehenlauf

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	30.09.2013
Referenz	30.09.2012

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)	
	30.09.2013	30.09.2012	30.09.2013	30.09.2012	30.09.2013	30.09.2012	30.09.2013	30.09.2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	95,00	50,00	98,09	54,21	80,14	43,94	114,53	62,27
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	135,91	81,31	150,86	92,01	130,37	79,11	166,84	100,58
davon gattungsklassische	125,91	71,31	140,10	81,08	120,90	69,69	155,34	88,83
davon sonstige Deckungswerte	10,00	10,00	10,76	10,93	9,47	9,42	11,50	11,74
Überdeckung in %	43,06%	62,62%	53,80%	69,73%	62,67%	80,06%	45,67%	61,51%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,97%	20,16%				

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.09.2013	30.09.2012	30.09.2013	30.09.2012	30.09.2013	30.09.2012
bis einschließlich 1 Jahr	5,30	2,59	0,00	0,00	5,30	2,59
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	5,77	3,20	0,00	0,00	5,77	3,20
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	7,08	4,23	0,00	0,00	7,08	4,23
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	6,72	4,96	0,00	0,00	6,72	4,96
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	7,83	3,12	0,00	0,00	7,83	3,12
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	95,99	59,83	95,00	50,00	0,99	9,83
über 10 Jahre	7,22	3,38	0,00	0,00	7,22	3,38

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	30.09.2013	30.09.2012	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.09.2013	30.09.2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
bis einschließlich 300 T€	108,89	63,92		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,00	0,00	0,00%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	17,01	7,39		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%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG	0,00	0,00	0,00%
wohnwirtschaftlich	116,24	65,96		Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)	10,00	10,00	10,53%
gewerblich	9,66	5,35		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,00	0,00	0,00%
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	135,91	81,31	143,06%
Wohnungen	48,99	31,07	36,05%				
Einfamilienhäuser	51,76	28,31	38,09%				
Mehrfamilienhäuser	15,49	6,59	11,40%				
Bürogebäude	0,54	0,00	0,40%				
Handelsgebäude	0,36	0,51	0,27%				
Industriegebäude	2,24	1,63	1,65%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	6,52	3,21	4,80%				
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)

	30.09.2013	30.09.2012
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	-	-