

Report zum Hypothekenpfandbriefumlauf
 ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

| | |
|----------|------------|
| Stichtag | 30.09.2011 |
| Referenz | 30.09.2010 |

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) | |
|---|------------|------------|------------|------------|--|------------|---|------------|
| | 30.09.2011 | 30.09.2010 | 30.09.2011 | 30.09.2010 | 30.09.2011 | 30.09.2010 | 30.09.2011 | 30.09.2010 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 10,0 | - | 10,2 | - | 8,2 | - | 12,7 | - |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 24,7 | - | 26,7 | - | 23,1 | - | 30,9 | - |
| davon gattungsklassische | 22,7 | - | 24,6 | - | 21,1 | - | 28,7 | - |
| davon sonstige Deckungswerte | 2,0 | - | 2,1 | - | 2,0 | - | 2,1 | - |
| Überdeckung in % | 147,0% | - | 162,5% | - | 182,6% | - | 142,7% | - |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in % | | | 20,6% | | | | | |

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

(Angaben in Mio. Euro)

| | Deckungsmasse | | Pfandbriefumlauf | | Überhang | |
|--------------------------|---------------|------------|------------------|------------|------------|------------|
| | 30.09.2011 | 30.09.2010 | 30.09.2011 | 30.09.2010 | 30.06.2011 | 30.09.2010 |
| unter 1 Jahr | 1,6 | - | 0,0 | - | 1,6 | - |
| 1 Jahr bis zu 2 Jahren | 2,9 | - | 0,0 | - | 2,9 | - |
| 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 0,7 | - | 0,0 | - | 0,7 | - |
| 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 0,6 | - | 0,0 | - | 0,6 | - |
| 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 2,6 | - | 0,0 | - | 2,6 | - |
| 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 14,9 | - | 10,0 | - | 4,9 | - |
| ab 10 Jahre | 1,4 | - | 0,0 | - | 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 | 30.09.2011 | 30.09.2010 | Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse | Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung) | 30.09.2011 | 30.09.2010 | Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs |
|---|------------|------------|--|--|------------|------------|--|
| | | | | | | | |
| nach Größenklassen | | | | sonstige Deckungswerte | 2,0 | - | 20,0% |
| bis einschließlich 300 T€ | 22,7 | - | | weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto | 0,0 | - | 0,0% |
| mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€ | 0,0 | - | | davon nach § 19 I Nr.2 PfandBG | 0,0 | - | 0,0% |
| mehr als 5 Mio.€ | 0,0 | - | | davon höchste Geldforderung geg. KI | 0,0 | - | 0,0% |
| | | | | Gesamtauslastung nach § 19 I Nr. 3 PfandBG | 0,0 | - | 0,0% |
| nach Nutzungsart (I) in Deutschland | | | | Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet) | 2,0 | - | 20,0% |
| wohnwirtschaftlich | 22,5 | - | | Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG | 0,0 | - | 0,0% |
| gewerblich | 0,2 | - | | | | | |
| nach Nutzungsart (II) in Deutschland | | | | Summe gattungsklassische und weitere Deckung | 24,7 | - | 247,0% |
| Wohnungen | 10,6 | - | 43,1% | | | | |
| Einfamilienhäuser | 10,6 | - | 43,0% | | | | |
| Mehrfamilienhäuser | 1,3 | - | 5,2% | | | | |
| Bürogebäude | 0,0 | - | 0,0% | | | | |
| Handelsgebäude | 0,0 | - | 0,0% | | | | |
| Industriegebäude | 0,0 | - | 0,0% | | | | |
| sonstige gewerblich genutzte Gebäude | 0,2 | - | 0,6% | | | | |
| unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten | 0,0 | - | 0,0% | | | | |
| Bauplätze | 0,0 | - | 0,0% | | | | |

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

| | 30.09.2011 | 30.09.2010 |
|--|------------|------------|
| Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen | 0,0 | - |