

Report zum Hypothekendarlehenpfandbriefumlauf
 ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	31.03.2012
Referenz	31.03.2011

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)	
	31.03.2012	31.03.2011	31.03.2012	31.03.2011	31.03.2012	31.03.2011	31.03.2012	31.03.2011
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	30,0	-	31,4	-	25,4	-	38,1	-
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	58,1	-	63,6	-	54,8	-	72,0	-
davon gattungsklassische	46,1	-	51,0	-	43,9	-	58,1	-
davon sonstige Deckungswerte	12,0	-	12,5	-	10,9	-	13,9	-
Überdeckung in %	93,7%	-	102,3%	-	115,7%	-	89,2%	-
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			39,8%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	31.03.2012	31.03.2011	31.03.2012	31.03.2011	31.03.2012	31.03.2011
unter 1 Jahr	1,9	-	0,0	-	1,9	-
1 Jahr bis zu 2 Jahren	3,7	-	0,0	-	3,7	-
2 Jahre bis zu 3 Jahren	3,4	-	0,0	-	3,4	-
3 Jahre bis zu 4 Jahren	3,5	-	0,0	-	3,5	-
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2,1	-	0,0	-	2,1	-
5 Jahre bis zu 10 Jahren	40,8	-	30,0	-	10,8	-
ab 10 Jahre	2,7	-	0,0	-	2,7	-

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	31.03.2012	31.03.2011	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	31.03.2012	31.03.2011	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				sonstige Deckungswerte	12,0	-	40,0%
bis einschließlich 300 T€	42,2	-		weitere Deckung gem. § 19 I Nr. 2-3 PfandBG brutto	0,0	-	0,0%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 5 Mio.€	3,9	-		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)	12,0	-	40,0%
wohnwirtschaftlich	43,1	-		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	0,0	-	0,0%
gewerblich	3,0	-					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung	58,1	-	193,66%
Wohnungen	20,3	-	34,9%				
Einfamilienhäuser	19,5	-	33,5%				
Mehrfamilienhäuser	3,4	-	5,8%				
Bürogebäude	0,0	-	0,0%				
Handelsgebäude	0,5	-	0,9%				
Industriegebäude	1,7	-	2,9%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	0,8	-	1,4%				
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)

	31.03.2012	31.03.2011
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,0	-