

Reporting gemäß §28 PfandBG für öffentliche Pfandbriefe per 30.06.2010

Angaben in Mio. EUR

1. Deckungsmasse für öffentliche Pfandbriefe	30.06.10	30.06.09
Nennwert	64.777	78.704
Barwert	69.158	83.286
Barwert (+250 BP und Währungsstress)	64.838	78.022
Barwert (-250 BP)	73.309	88.879

Umlauf an öffentlichen Pfandbriefen	30.06.10	30.06.09
Umlaufendes Volumen	54.765	68.568
Barwert	59.158	73.110
Barwert (+250 BP und Währungsstress)	55.510	68.527
Barwert (-250 BP)	62.368	77.887

Überdeckung	30.06.10	30.06.09
Nennwert	10.012	10.136
Barwert	10.000	10.176
Barwert (+250 BP und Währungsstress)	9.328	9.495
Barwert (-250 BP)	10.941	10.992

Weitere Deckungswerte	30.06.10	30.06.09
Nennwert	35	15

2. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse	30.06.10	30.06.09
	0	0

3. Laufzeitstruktur	bis 1 Jahr		>1 Jahr bis 2 Jahre		>2 Jahre bis 3 Jahre		>3 Jahre bis 4 Jahre		>4 Jahre bis 5 Jahre	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Deckungsmasse	12.488	15.242	9.564	11.627	8.989	9.394	8.239	8.687	8.629	8.393
Umlaufende öffentliche Pfandbriefe	13.546	15.685	8.874	13.363	9.890	8.568	7.934	9.863	4.971	7.907

3. Laufzeitstruktur	>5 Jahre bis 10 Jahre		>10 Jahre		Gesamt	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Deckungsmasse	11.735	19.794	5.133	5.567	64.777	78.704
Umlaufende öffentliche Pfandbriefe	7.585	11.006	1.965	2.176	54.765	68.568

4. Gesamtnennwert der Deckungsmassen nach Land/Art	Staat		regionale Gebietskörperschaft		örtliche Gebietskörperschaft		sonstige Schuldner ²⁾		Gesamt	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
	Bundesrepublik Deutschland	1.184	1.352	7.737	9.251	6.290	6.753	46.926	57.161	62.137
Finnland	12	47	0	0	0	0	0	0	12	47
Frankreich inkl. Monaco	0	50	2	3	7	10	0	0	9	63
Griechenland	320	1.014	0	0	0	0	0	0	320	1.014
Großbritannien	157	76	0	0	0	0	0	0	157	76
Island	20	20	0	0	0	0	0	0	20	20
Italien	43	677	39	142	22	0	0	0	104	819
Japan	300	300	0	0	0	0	0	0	300	300
Lettland	30	30	0	0	64	0	0	0	94	30
Luxemburg	0	0	0	0	0	0	0	9	0	9
Polen	22	27	0	0	0	0	0	0	22	27
Kanada	0	0	70	57	0	0	0	0	70	57
Österreich	15	15	0	10	12	12	0	0	27	37
Schweiz	0	0	753	1.152	0	0	0	0	753	1.152
Slowakei	0	80	0	0	0	0	0	0	0	80
Spanien	0	0	234	238	42	48	0	0	276	286
Tschechische Republik	15	65	0	0	0	0	0	0	15	65
Ungarn	49	49	0	0	0	0	0	0	49	49
Vereinigte Staaten von Amerika (Inkl. Puerto Rico)	253	0	137	21	0	0	22	25	412	46
Zypern	0	10	0	0	0	0	0	0	0	10
Gesamt	2.420	3.812	8.972	10.874	6.437	6.823	46.948	57.195	64.777	78.704

²⁾ Die Position beinhaltet Sparkassen und Landesbanken mit Gewährträgerhaftung i.H.v. 37.543 Mio.€ (45.508 Mio.€) und die Förderbanken i.H.v. 4.872 Mio.€ (6.954 Mio.€).

5. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen nach Land/Art	Staat		regionale Gebietskörperschaft		örtliche Gebietskörperschaft		sonstige Schuldner		Gesamt	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Bundesrepublik Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Finnland	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Frankreich inkl. Monaco	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Griechenland	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Großbritannien	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Island	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Italien	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Japan	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Lettland	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Luxemburg	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Polen	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Kanada	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Österreich	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Schweiz	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Slowakei	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Spanien	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Tschechische Republik	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Ungarn	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Vereinigte Staaten von Amerika (Inkl. Puerto Rico)	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Zypern	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Gesamt	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

Reporting gemäß §28 PfandBG für Hypothekendarlehen per 30.06.2010

Angaben in Mio. EUR

1. Deckungsmasse für Hypothekendarlehen		
	30.06.10	30.06.09
Nennwert	9.075	7.154
Barwert	9.941	7.692
Barwert (+250 BP und Währungsstress)	9.060	6.982
Barwert (-250 BP)	10.816	8.515

Umlauf an Hypothekendarlehen		
	30.06.10	30.06.09
Umlaufendes Volumen	4.362	4.303
Barwert	4.632	4.517
Barwert (+250 BP und Währungsstress)	4.308	4.191
Barwert (-250 BP)	4.954	4.878

Überdeckung		
	30.06.10	30.06.09
Nennwert	4.713	2.851
Barwert	5.309	3.175
Barwert (+250 BP und Währungsstress)	4.752	2.791
Barwert (-250 BP)	5.862	3.637

Weitere Deckungswerte		
	30.06.10	30.06.09
Nennwert	150	0

2. Anteil der Derivate an der Deckungsmasse		
	30.06.10	30.06.09
	0	0

3. Laufzeitstruktur	bis 1 Jahr		>1 Jahr bis 2 Jahre		>2 Jahre bis 3 Jahre		>3 Jahre bis 4 Jahre		>4 Jahre bis 5 Jahre	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Deckungsmasse	1.144	1.098	815	562	1.149	563	1.036	826	932	680
Umlaufende Hypothekendarlehen	894	816	909	763	459	775	459	393	503	302

3. Laufzeitstruktur	>5 Jahre bis 10 Jahre		>10 Jahre		Gesamt	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Deckungsmasse	3.312	2.792	687	633	9.075	7.154
Umlaufende Hypothekendarlehen	1.126	1.239	12	15	4.362	4.303

4. Gesamtnennwert der Deckungsmassen nach Höhe der einzelnen Deckungsmassen	bis 300 TEUR		über 300 TEUR bis 5 Mio. EUR		über 5 Mio. EUR		Gesamt	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
	3.441	2.836	2.578	2.067	3.056	2.251	9.075	7.154

5. Gesamtnennwert der Deckungsmassen nach Nutzungsart/Land	Bundesrepublik Deutschland		Niederlande		Frankreich		Belgien		USA	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Gewerblich genutzte Grundstücke	1	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Wohnungen	1.153	973	0	0	0	0	0	0	0	0
Einfamilienhäuser	1.568	1.294	0	0	0	0	0	0	0	0
Mehrfamilienhäuser	2.315	2.089	0	0	0	0	0	0	0	0
Bürogebäude	985	749	30	30	31	0	37	6	183	28
Handelsgebäude	664	603	0	0	14	14	0	0	0	0
Industriegebäude	72	38	0	0	0	0	0	0	0	0
Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	1.549	1.039	0	0	0	0	0	0	0	0
Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	138	159	0	0	0	0	0	0	0	0
Bauplätze	16	16	0	0	0	0	0	0	0	0
Sonstige Deckung	267	116	0	0	0	0	0	0	0	0
Gesamt	8.728	7.076	30	30	45	14	37	6	183	28

5. Gesamtnennwert der Deckungsmassen nach Nutzungsart/Land	Großbritannien/Norir- land Brit. Kanalinseln		Gesamt	
	30.06.10	30.06.09	30.06.10	30.06.09
Gewerblich genutzte Grundstücke	0	0	1	0
Wohnwirtschaftlich genutzte Grundstücke	0	0	0	0
Wohnungen	0	0	1.153	973
Einfamilienhäuser	0	0	1.568	1.294
Mehrfamilienhäuser	0	0	2.315	2.089
Bürogebäude	34	0	1.300	813
Handelsgebäude	0	0	678	617
Industriegebäude	0	0	72	38
Sonstige gewerblich genutzte Gebäude	18	0	1.567	1.039
Unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	0	0	138	159
Bauplätze	0	0	16	16
Sonstige Deckung	0	0	267	116
Gesamt	52	0	9.075	7.154

6. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen nach Land	Gesamt	
	30.06.10	30.06.09
Bundesrepublik Deutschland	0	0
Niederlande	0	0
Frankreich	0	0
Belgien	0	0
USA	0	0
Großbritannien/Nordirland Brit. Kanalinseln	0	0