

Nominalbetrag		
	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Hypothekenzinspfandbriefe	13.154.025	12.116.391
davon:		
Derivate	0	0
Deckungsmasse	15.054.618	12.851.738
davon:		
weitere Deckungswerte	1.225.464	1.095.213
Derivate	4.134	-997
Überdeckung	1.900.593	735.347

Barwert		
	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Hypothekenzinspfandbriefe	13.771.761	12.246.024
davon:		
Derivate	0	0
Deckungsmasse	16.212.036	13.102.979
davon:		
weitere Deckungswerte	1.207.644	1.128.898
Derivate	3.475	-1.066
Überdeckung	2.440.275	856.955

Risikobarwert *)		
	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Hypothekenzinspfandbriefe	13.141.520	11.667.729
Deckungsmasse	14.801.057	12.083.525
Überdeckung nach Stresstest	1.659.537	415.796

*) Stresstest mit dem dynamischen Ansatz nach § 4 und § 5 PfandBarwertV

Laufzeitstruktur (Restlaufzeit) 30.09.2009							
	bis einschl. 1 Jahr	mehr als 1 Jahr - einschl. 2 Jahre	mehr als 2 Jahre - einschl. 3 Jahre	mehr als 3 Jahr - einschl. 4 Jahre	mehr als 4 Jahre - einschl. 5 Jahre	mehr als 5 Jahre - einschl. 10 Jahre	länger als 10 Jahre
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Hypothekenzinspfandbriefe	2.651.023	1.909.894	1.232.375	3.333.176	335.062	1.725.519	1.966.976
Deckungsmasse	1.910.573	1.348.777	2.175.111	1.718.464	1.627.876	4.972.633	1.301.184

Laufzeitstruktur (Restlaufzeit) 30.09.2008							
	bis einschl. 1 Jahr	mehr als 1 Jahr - einschl. 2 Jahre	mehr als 2 Jahre - einschl. 3 Jahre	mehr als 3 Jahr - einschl. 4 Jahre	mehr als 4 Jahre - einschl. 5 Jahre	mehr als 5 Jahre - einschl. 10 Jahre	länger als 10 Jahre
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Hypothekenzinspfandbriefe	3.723.017	1.697.279	390.401	431.168	2.854.810	1.127.555	1.892.161
Deckungsmasse	1.778.156	1.351.100	1.113.521	1.032.585	1.272.983	4.870.524	1.432.869

Veröffentlichung nach § 28 Abs. 1 Nr. 1 bis 3 PfandBG

Umlaufende Öffentliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

	Nominalbetrag	
	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Öffentliche Pfandbriefe	10.917.459	12.939.048
Deckungsmasse	11.731.716	13.540.299
davon:		
weitere Deckungswerte	1.320.000	708.200
Derivate	5.627	0
Überdeckung	814.257	601.251

	Barwert	
	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Öffentliche Pfandbriefe	11.839.283	13.142.752
Deckungsmasse	12.881.101	14.019.050
davon:		
weitere Deckungswerte	1.410.714	764.469
Derivate	19.099	2.986
Überdeckung	1.041.818	876.298

	Risikobarwert *)	
	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Öffentliche Pfandbriefe	12.795.405	14.015.350
Deckungsmasse	13.847.060	14.775.995
Überdeckung nach Stresstest	1.051.655	760.645

*) Stresstest mit dem dynamischen Ansatz nach § 4 und § 5 PfandBarwertV

	Laufzeitstruktur (Restlaufzeit) 30.09.2009						
	bis einschl. 1 Jahr	mehr als 1 Jahr - einschl. 2 Jahre	mehr als 2 Jahre - einschl. 3 Jahre	mehr als 3 Jahr - einschl. 4 Jahre	mehr als 4 Jahre - einschl. 5 Jahre	mehr als 5 Jahre - einschl. 10 Jahre	länger als 10 Jahre
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Öffentliche Pfandbriefe	1.491.579	3.106.065	1.971.708	518.375	546.126	945.713	2.337.893
Deckungsmasse	1.766.976	1.596.510	742.353	1.257.297	1.101.541	3.497.663	1.769.376

	Laufzeitstruktur (Restlaufzeit) 30.09.2008						
	bis einschl. 1 Jahr	mehr als 1 Jahr - einschl. 2 Jahre	mehr als 2 Jahre - einschl. 3 Jahre	mehr als 3 Jahr - einschl. 4 Jahre	mehr als 4 Jahre - einschl. 5 Jahre	mehr als 5 Jahre - einschl. 10 Jahre	länger als 10 Jahre
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Öffentliche Pfandbriefe	2.422.668	1.310.827	3.059.400	2.034.591	509.107	1.510.537	2.091.918
Deckungsmasse	1.976.656	1.633.795	1.661.688	807.973	1.137.477	4.555.640	1.767.070

Veröffentlichung nach § 28 Abs. 2 Satz 1 Nr. 1 PfandBG

Zur Deckung von Hypotheken-Pfandbriefen verwendete Forderungen

A. Nach Grössengruppen

	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
bis einschl. € 300.000	7.553.924	7.071.699
mehr als € 300.000 bis einschl. € 5 Mio.	2.206.915	2.060.612
mehr als € 5 Mio.	4.064.181	2.625.211
Summe	13.825.020	11.757.522

B. Nach Nutzungsart und nach Gebieten, in denen die beliebigen Grundstücke liegen

	30.09.2009		30.09.2008	
	gewerblich	wohnwirtschaftlich	gewerblich	wohnwirtschaftlich
	Tsd. €	Tsd. €	Tsd. €	Tsd. €
Bundesrepublik Deutschland				
Wohnungen		2.332.196		2.248.036
Einfamilienhäuser		3.643.080		3.536.729
Mehrfamilienhäuser		2.871.292		2.764.471
Bürogebäude	942.532		793.610	
Handelsgebäude	580.968		482.464	
Industriegebäude	75.065		91.774	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	305.261		147.520	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	1.124	88.929	1.850	104.022
Bauplätze	1.178	2.839	1.519	2.249
	1.906.128	8.938.336	1.518.737	8.655.507

davon in

Baden-Württemberg	224.673	1.184.628	205.779	1.181.946
Bayern	349.485	2.278.327	357.117	2.188.307
Berlin	178.485	323.116	28.135	278.097
Brandenburg	4.755	107.463	5.244	92.287
Bremen	386	22.879	451	24.118
Hamburg	148.200	189.656	82.128	180.977
Hessen	359.262	692.496	342.824	727.798
Mecklenburg-Vorpommern	4.879	56.646	5.190	53.358
Niedersachsen	55.024	679.937	59.334	629.922
Nordrhein-Westfalen	312.950	1.909.849	257.699	1.848.396
Rheinland-Pfalz	108.819	244.246	26.110	241.639
Saarland	6.268	27.566	7.200	32.338
Sachsen	72.455	298.906	68.773	293.363
Sachsen-Anhalt	4.143	73.656	4.720	75.115
Schleswig-Holstein	56.410	718.804	62.662	672.039
Thüringen	19.934	130.161	5.371	135.807

Frankreich				
Wohnungen		0		9.480
Bürogebäude	210.093		138.171	
Handelsgebäude	20.520		23.963	
	230.613	0	162.134	9.480

Großbritannien				
Bürogebäude	79.751		92.014	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	11.840		13.622	
	91.591		105.636	

Luxemburg				
Bürogebäude	60.000		12.000	
Handelsgebäude	4.250		4.250	
	64.250		16.250	

Niederlande				
Bürogebäude	173.006		170.357	
Handelsgebäude	9.654		9.654	
	182.660		180.011	
Österreich				
Einfamilienhäuser		73		76
Bürogebäude	34.291		33.602	
	34.291	73	33.602	76
Schweden				
Bürogebäude	29.789		31.121	
	29.789		31.121	
Spanien				
Bürogebäude	7.900		8.100	
Handelsgebäude	15.450		0	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	22.111		0	
	45.461		8.100	
Schweiz				
Wohnungen		116.567		0
Einfamilienhäuser		306.479		0
Bürogebäude	23.391		0	
	23.391	423.046	0	0
USA				
Wohnungen		321.609		99.885
Mehrfamilienhäuser		0		23.139
Bürogebäude	1.082.691		635.176	
Handelsgebäude	121.975		125.983	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	304.817		95.162	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	24.299	0	0	57.523
	1.533.782	321.609	856.321	180.547
Gesamtsumme				
Wohnungen	4.141.956	9.683.064	2.911.912	8.845.610
Einfamilienhäuser		2.770.372		2.357.401
Mehrfamilienhäuser		3.949.632		3.536.805
Bürogebäude		2.871.292		2.787.610
Handelsgebäude	2.643.444		1.914.151	
Industriegebäude	752.817		646.314	
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	75.065		91.774	
unfertige und noch nicht ertragsfähige Neubauten	644.029		256.304	
Bauplätze	25.423	88.929	1.850	161.545
	1.178	2.839	1.519	2.249

Veröffentlichung nach § 28 Abs. 2 Satz 1 Nr. 2 PfandBG
Rückständige Leistungen auf Deckungshypotheken

	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Bundesrepublik Deutschland	21.865	28.675
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	21.865	28.675

Veröffentlichung nach § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

Deckungswerte	30.09.2009	30.09.2008
	<i>Tsd. €</i>	<i>Tsd. €</i>
Bundesrepublik Deutschland		
regionale Gebietskörperschaften	4.026.124	4.783.153
örtliche Gebietskörperschaften	1.652.046	1.914.985
sonstige	2.890.793	4.171.373
	8.568.963	10.869.511
BELGIEN		
Staat	175.000	175.000
	175.000	175.000
FRANKREICH		
örtliche Gebietskörperschaften	1.256	1.505
	1.256	1.505
GRIECHENLAND		
Staat	68.000	110.087
	68.000	110.087
GROSSBRITANNIEN		
Staat	0	25.307
	0	25.307
IRLAND		
Staat	22.695	22.695
	22.695	22.695
ISLAND		
Staat	60.000	60.000
	60.000	60.000
ITALIEN		
Staat	111.631	119.340
regionale Gebietskörperschaften	5.000	5.000
	116.631	124.340
LITAUEN		
Staat	30.000	30.000
	30.000	30.000
NIEDERLANDE		
Staat	1.475	1.475
	1.475	1.475

ÖSTERREICH		
Staat	147.532	190.347
Sonstige	160.000	172.500
	307.532	362.847
POLEN		
Staat	118.161	116.698
	118.161	116.698
PORTUGAL		
Staat	85.000	85.000
regionale Gebietskörperschaften	10.000	10.000
	95.000	95.000
SCHWEDEN		
Staat	10.226	10.226
	10.226	10.226
SCHWEIZ		
regionale Gebietskörperschaften	152.540	145.810
Sonstige	208.161	206.698
	360.701	352.508
SLOWAKEI		
Staat	5.000	5.000
	5.000	5.000
SLOWENIEN		
Staat	100.000	100.000
	100.000	100.000
SPANIEN		
Staat	0	18.655
regionale Gebietskörperschaften	161.958	141.958
	161.958	160.613
TSCHECHIEN		
Staat	95.000	95.000
	95.000	95.000
UNGARN		
Staat	70.000	70.000
	70.000	70.000
EU-Institutionen		
Sonstige	38.491	44.287
	38.491	44.287
GESAMTSUMME	10.406.089	12.832.099
Staat	1.099.720	1.234.830
regionale Gebietskörperschaften	4.355.622	5.085.921
örtliche Gebietskörperschaften	1.653.302	1.916.490
sonstige	3.297.445	4.594.858