

# Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	I 2011
Referenz	I 2010

## I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	24.557,78	30.172,15	25.899,51	32.385,84	24.071,11	30.821,87
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	27.445,72	32.259,18	29.145,57	34.957,45	27.153,84	33.237,89
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	11,76%	6,92%	12,53%	7,94%	12,81%	7,84%

	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010
unter 1 Jahr	2.790,88	5.192,44	3.200,17	3.110,00
1 Jahr bis zu 2 Jahren	2.911,09	2.779,46	2.875,37	4.099,22
2 Jahre bis zu 3 Jahren	3.123,50	2.913,59	3.521,65	3.734,48
3 Jahre bis zu 4 Jahren	921,39	3.121,20	4.159,18	3.690,97
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2.237,80	919,38	2.340,85	4.384,94
5 Jahre bis zu 10 Jahren	7.720,14	9.345,31	5.132,15	6.498,59
ab 10 Jahre	4.852,98	5.900,78	6.216,34	6.740,98

\* Ermittlung des Risikobarwerts erfolgt dynamisch. Der Währungsstreß wird statisch berechnet.

## II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	I 2011	I 2010
Weitere Deckung - unter Berücksichtigung §4 (1a) S.4 nach § 20 (II) 2. PfandBG	0,00%	1,47%

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010
Belgien	30,00	70,00	90,83	92,50	-	-	-	-	120,83	162,50
Bundesrepublik Deutschland	22,25	2,28	4.643,65	6.035,72	8.719,57	9.437,52	4.040,12	4.903,44	17.425,59	20.378,96
Dänemark	-	-	-	-	-	-	40,00	60,00	40,00	60,00
Frankreich	-	-	100,00	100,00	-	-	211,00	580,00	311,00	680,00
Griechenland	450,00	681,13	-	-	-	-	-	-	450,00	681,13
Großbritannien	75,00	-	-	-	-	-	239,00	229,00	314,00	229,00
Irland	-	50,00	-	-	-	-	-	-	0,00	50,00
Italien	843,28	843,58	532,11	510,69	230,00	230,00	65,00	263,00	1.670,39	1.847,27
Kanada	-	-	397,99	419,49	-	-	-	-	397,99	419,49
Luxemburg	-	-	-	-	-	-	180,00	180,00	180,00	180,00
Niederlande	-	-	-	-	-	-	230,00	230,00	230,00	230,00
Norwegen (mit Spitzbergen)	-	-	-	-	-	-	20,00	20,00	20,00	20,00
Österreich	370,00	370,00	154,67	7,33	-	-	465,31	622,31	989,97	999,64
Polen	70,00	100,00	-	-	-	-	-	-	70,00	100,00
Portugal	570,10	825,10	75,00	75,00	-	-	-	-	645,10	900,10
Schweiz	-	-	219,15	199,64	-	-	207,67	202,54	426,82	402,17
Slowakei	35,00	35,00	-	-	-	-	-	-	35,00	35,00
Slowenien	40,00	70,00	-	-	-	-	-	-	40,00	70,00
Spanien	-	-	2.786,21	3.289,72	97,33	97,33	1.020,00	1.200,00	3.903,54	4.587,05
Tschechische Republik	50,00	50,00	-	-	-	-	-	-	50,00	50,00
USA	-	-	112,88	118,98	5,34	5,62	-	45,00	118,22	169,60
Zypern	7,27	7,27	-	-	-	-	-	-	7,27	7,27
<b>Summe</b>	<b>2.562,90</b>	<b>3.104,36</b>	<b>9.112,49</b>	<b>10.849,06</b>	<b>9.052,23</b>	<b>9.770,47</b>	<b>6.718,09</b>	<b>8.535,28</b>	<b>27.445,72</b>	<b>32.259,18</b>

## III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

Rückständige Leistungen von > 90 Tagen auf die zur Deckung verwendeten Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2011	I 2010	I 2011	IV 2006	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010	I 2011	I 2010
Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,72	9,65	3,72	9,65
<b>Summe</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3,72</b>	<b>9,65</b>	<b>3,72</b>	<b>9,65</b>