

Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	III 2010
Referenz	III 2009

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	27.874,27	31.650,92	31.003,65	33.716,41	29.448,87	31.434,12
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	30.165,52	33.621,09	33.717,50	36.233,66	32.011,70	33.848,23
% Fremdwährungsderivate v. Passiva						
% Zinsderivate v. Passiva						
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva						
% Zinsderivate v. Aktiva						
Überdeckung in %	8,22%	6,22%	8,75%	7,47%	8,70%	7,68%

	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009
unter 1 Jahr	3.370,99	3.895,19	3.572,44	3.501,77
1 Jahr bis zu 2 Jahren	2.914,84	3.340,66	3.704,42	3.449,08
2 Jahre bis zu 3 Jahren	2.883,31	2.914,84	2.611,40	3.932,94
3 Jahre bis zu 4 Jahren	3.124,98	2.883,31	5.212,66	3.216,13
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2.015,36	3.124,98	2.685,39	5.237,69
5 Jahre bis zu 10 Jahren	7.991,31	9.194,03	5.787,54	7.602,03
ab 10 Jahre	5.573,49	6.297,91	6.591,66	6.681,45

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

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	III 2010	III 2009
Weitere Deckung - unter Berücksichtigung §4 (1a) S.4		
nach § 20 (II) 2. PfandBG	0,00%	1,21%

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009
Belgien	30,00	30,00	91,67	93,33					121,67	123,33
Bundesrepublik Deutschland	22,27	2,31	6.253,13	6.749,85	9.032,81	9.703,27	4.310,81	5.357,11	19.619,02	21.812,54
Dänemark							40,00	60,00	40,00	60,00
Frankreich			100,00	100,00			240,00	580,00	340,00	680,00
Griechenland	450,00	679,91							450,00	679,91
Großbritannien / Nordirland Brit.k							129,00	229,00	129,00	229,00
Irland	50,00	50,00							50,00	50,00
Italien	843,43	843,73	499,93	521,17	230,00	230,00	138,00	135,00	1.711,36	1.729,90
Kanada			414,29	386,14					414,29	386,14
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
Polen	100,00	100,00							100,00	100,00
Portugal	745,10	745,10	75,00	75,00					820,10	820,10
Schweiz			214,50	189,02			206,45	199,74	420,94	388,76
Slowakei	35,00	35,00							35,00	35,00
Slowenien	75,00	60,00						10,00	75,00	70,00
Spanien			3.106,17	3.555,32	97,33	97,33	1.035,00	1.150,00	4.238,50	4.802,65
Tschechische Republik	50,00	50,00							50,00	50,00
USA			117,50	109,52	5,55	12,01		45,00	123,06	166,53
Zypern	7,27	7,27							7,27	7,27
Österreich	370,00	370,00	155,00	7,67			465,31	622,31	990,31	999,97
Summe	2.778,07	2.973,32	11.027,20	11.787,01	9.365,70	10.042,61	6.994,56	8.818,15	30.165,52	33.621,09

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	
	III 2010	III 2009	III 2010	IV 2006	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009	III 2010	III 2009
Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8,83	9,95	8,83	9,95
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8,83	9,95	8,83	9,95