

Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	I 2010
Referenz	I 2009

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	30.172,15	35.666,46	32.385,84	38.041,59	30.821,87	35.710,56
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	32.259,18	38.165,21	34.957,45	41.287,83	33.237,89	38.826,93
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	6,92%	7,01%	7,94%	8,53%	7,84%	8,73%

	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009
unter 1 Jahr	5.192,44	5.573,82	3.110,00	5.293,91
1 Jahr bis zu 2 Jahren	2.779,46	5.160,96	4.099,22	5.084,60
2 Jahre bis zu 3 Jahren	2.913,59	2.789,46	3.734,48	4.409,75
3 Jahre bis zu 4 Jahren	3.121,20	2.913,59	3.690,97	3.302,80
4 Jahre bis zu 5 Jahren	919,38	3.121,20	4.384,94	3.730,56
5 Jahre bis zu 10 Jahren	9.345,31	9.642,14	6.498,59	9.294,74
ab 10 Jahre	5.900,78	6.465,28	6.740,98	7.048,85

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

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	I 2010	I 2009
Weitere Deckung - unter Berücksichtigung . §4 (1a) S.4 nach § 20 (II) 2. PfandBG	1,47%	1,05%

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009
Belgien	70,00	70,00	92,50	94,17	-	-	-	-	162,50	164,17
Bundesrepublik Deutschland	2,28	2,37	6.035,72	8.046,00	9.437,52	10.251,36	4.903,44	6.436,98	20.378,96	24.736,71
Dänemark	-	-	-	-	-	-	60,00	20,00	60,00	20,00
Frankreich	-	-	100,00	225,00	-	-	580,00	210,00	680,00	435,00
Griechenland	681,13	434,88	-	235,00	-	-	-	240,00	681,13	909,88
Großbritannien	-	-	-	-	-	-	229,00	304,00	229,00	304,00
Irland	50,00	50,00	-	-	-	-	-	95,00	50,00	145,00
Italien	843,58	814,33	510,69	834,27	230,00	175,00	263,00	-	1.847,27	1.823,60
Kanada	-	-	419,49	534,88	-	-	-	-	419,49	534,88
Lettland	-	25,00	-	-	-	-	-	-	-	25,00
Litauen	-	-	-	22,50	-	-	-	-	-	22,50
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	-
Polen	100,00	100,00	-	-	-	-	-	-	100,00	100,00
Portugal	825,10	723,48	75,00	75,00	-	-	-	270,10	900,10	1.068,58
Schweiz	-	-	199,64	188,09	-	-	202,54	199,50	402,17	387,59
Slowakei	35,00	35,00	-	-	-	-	-	-	35,00	35,00
Slowenien	70,00	65,00	-	-	-	-	-	10,00	70,00	75,00
Spanien	-	-	3.289,72	4.305,09	97,33	30,83	1.200,00	1.135,00	4.587,05	5.470,92
Tschechische Republik	50,00	50,00	-	-	-	-	-	-	50,00	50,00
USA	-	-	118,98	120,51	5,62	50,78	45,00	45,00	169,60	216,29
Ungarn	-	81,51	-	-	-	-	-	-	-	81,51
Zypern	7,27	7,27	-	-	-	-	-	-	7,27	7,27
Österreich	370,00	180,00	7,33	314,50	-	-	622,31	647,81	999,64	1.142,31
Summe	3.104,36	2.638,85	10.849,06	14.995,00	9.770,47	10.507,97	8.535,28	10.023,39	32.259,18	38.165,21

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 2010	I 2009	I 2010	IV 2006	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009	I 2010	I 2009
Deutschland	-	-	-	-	-	-	9,65	9,21	9,65	9,21
Summe	-	-	-	-	-	-	9,65	9,21	9,65	9,21