

Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	IV 2010
Referenz	IV 2009

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	26.430,86	31.072,69	28.555,20	32.971,61	26.866,50	31.103,95
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	29.146,71	33.467,93	31.580,32	35.782,78	29.711,43	33.768,53
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	10,28%	7,71%	10,59%	8,53%	10,59%	8,57%

	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009
unter 1 Jahr	2.128,94	4.684,59	3.187,17	3.120,30
1 Jahr bis zu 2 Jahren	3.124,46	2.099,12	3.114,94	3.908,30
2 Jahre bis zu 3 Jahren	2.939,02	3.129,26	3.569,73	4.115,29
3 Jahre bis zu 4 Jahren	2.904,98	2.939,02	5.194,92	3.905,09
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2.002,56	2.894,62	1.869,22	5.150,71
5 Jahre bis zu 10 Jahren	8.263,31	9.350,26	5.766,89	6.538,44
ab 10 Jahre	5.067,59	5.975,82	6.443,84	6.729,80

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

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	IV 2010	IV 2009
Weitere Deckung - unter Berücksichtigung §4 (1a) S.4 nach § 20 (II) 2. PfandBG	0,00%	0,44%

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009
Belgien	30,00	70,00	90,83	92,50					120,83	162,50
Bundesrepublik Deutschland	22,25	2,28	5.550,38	6.433,67	8.797,26	9.498,82	3.980,16	5.195,62	18.350,05	21.130,40
Dänemark							40,00	60,00	40,00	60,00
Frankreich			100,00	100,00			276,00	580,00	376,00	680,00
Griechenland	450,00	879,62							450,00	879,62
Großbritannien / Nordirland Brit.K	75,00						239,00	229,00	314,00	229,00
Irland	50,00	50,00							50,00	50,00
Italien	843,43	843,73	537,66	516,01	230,00	230,00	201,15	263,00	1.812,24	1.852,74
Kanada			485,77	394,36					485,77	394,36
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	100,00	100,00							100,00	100,00
Portugal	745,10	825,10	75,00	75,00					820,10	900,10
Schweiz			228,46	191,56			210,12	200,41	438,58	391,97
Slowakei	35,00	35,00							35,00	35,00
Slowenien	70,00	70,00							70,00	70,00
Spanien			2.963,10	3.585,88	97,33	97,33	1.020,00	1.200,00	4.080,43	4.883,21
Tschechische Republik	50,00	50,00							50,00	50,00
USA			120,76	111,85	5,71	5,29		45,00	126,47	162,14
Zypern	7,27	7,27							7,27	7,27
Summe	2.848,05	3.303,00	10.306,63	11.508,16	9.130,30	9.831,44	6.861,73	8.825,34	29.146,71	33.467,93

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	
	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2006	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009	IV 2010	IV 2009
Deutschland	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,96	9,27	2,96	9,27
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2,96	9,27	2,96	9,27