

Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	III 2011
Referenz	III 2010

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	23.613,72	27.874,27	26.340,51	31.003,65	24.940,08	29.448,87
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	26.378,55	30.165,52	29.586,41	33.717,50	27.944,14	32.011,70
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Passiva	-	-	-	-	-	-
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
% Zinsderivate v. Aktiva	-	-	-	-	-	-
Überdeckung in %	11,71%	8,22%	12,32%	8,75%	12,05%	8,70%

	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010
unter 1 Jahr	2.926,26	3.370,99	3.456,52	3.572,44
1 Jahr bis zu 2 Jahren	2.881,31	2.914,84	2.285,92	3.704,42
2 Jahre bis zu 3 Jahren	3.127,28	2.883,31	4.907,18	2.611,40
3 Jahre bis zu 4 Jahren	2.018,35	3.124,98	2.748,26	5.212,66
4 Jahre bis zu 5 Jahren	2.101,90	2.015,36	2.158,54	2.685,39
5 Jahre bis zu 10 Jahren	5.896,72	7.991,31	4.930,25	5.787,54
ab 10 Jahre	4.661,91	5.573,49	5.891,88	6.591,66

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

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

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

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010
Belgien	30,00	30,00	90,00	91,67	-	-	-	-	120,00	121,67
Bundesrepublik Deutschland	20,07	22,27	4.562,08	6.253,13	8.506,30	9.032,81	3.811,09	4.310,81	16.899,54	19.619,02
Dänemark	-	-	-	-	-	-	-	40,00	0,00	40,00
Frankreich	-	-	100,00	100,00	-	-	190,00	240,00	290,00	340,00
Griechenland	-	450,00	-	-	-	-	-	-	0,00	450,00
Großbritannien	75,00	-	-	-	-	-	164,00	129,00	239,00	129,00
Irland	-	50,00	-	-	-	-	-	-	0,00	50,00
Italien	843,12	843,43	521,00	499,93	230,00	230,00	75,00	138,00	1.669,12	1.711,36
Kanada	-	-	418,74	414,29	-	-	-	-	418,74	414,29
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	154,33	155,00	-	-	465,31	465,31	989,64	990,31
Polen	70,00	100,00	-	-	-	-	-	-	70,00	100,00
Portugal	570,10	745,10	75,00	75,00	-	-	-	-	645,10	820,10
Schweiz	-	-	234,18	214,50	-	-	211,63	206,45	445,81	420,94
Slowakei	35,00	35,00	-	-	-	-	-	-	35,00	35,00
Slowenien	40,00	75,00	-	-	-	-	-	-	40,00	75,00
Spanien	-	-	2.787,62	3.106,17	97,33	97,33	1.020,00	1.035,00	3.904,95	4.238,50
Tschechische Republik	50,00	50,00	-	-	-	-	-	-	50,00	50,00
USA	-	-	118,77	117,50	5,61	5,55	-	-	124,38	123,06
Zypern	7,27	7,27	-	-	-	-	-	-	7,27	7,27
Summe	2.110,56	2.778,07	9.061,73	11.027,20	8.839,24	9.365,70	6.367,02	6.994,56	26.378,55	30.165,52

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 2011	III 2010	III 2011	IV 2006	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010	III 2011	III 2010
Deutschland	-	-	-	-	-	-	3,78	8,83	3,78	8,83
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,78	8,83	3,78	8,83