

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach oben)		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach unten)	
	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	120,00	65,00	129,63	65,12	108,90	55,11	155,70	77,56
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	194,03	116,54	213,15	118,65	193,48	108,18	235,10	130,91
Überdeckung in %	61,69%	79,30%	64,44%	82,21%	77,67%	96,29%	51,00%	68,79%

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 2 Jahre		2 Jahre < x <= 3 Jahre		3 Jahr < x <= 4 Jahre	
	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	-	-	10,00	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	19,40	-	19,75	15,00	10,63	15,00	14,47	0,00

	4 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008	III 2009	III 2008
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	65,00	65,00	45,00	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	14,47	31,55	95,75	54,99	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate. Deckungswerte nach §20 Abs.2 Nr.2 Pfandbriefgesetz bestehen nicht.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2009	III 2008
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	194,03	116,54

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung	Sonstige Körperschaften des öffentlichen Rechts
Bundesrepublik Deutschland III 2009	40,00	57,07	48,01	40,00	8,95
Bundesrepublik Deutschland III 2008	40,00	21,04	11,55	35,00	8,95

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2009	III 2008
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	-	-

Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-