

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 2007	III 2006	III 2007	III 2006	III 2007	III 2006	III 2007	III 2006
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	35,00	25,00	34,47	26,08	28,97	21,61	41,35	31,77
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	75,00	65,00	76,39	66,34	69,70	58,99	84,18	74,99
Überdeckung in %	114,29%	160,00%	121,62%	154,34%	140,58%	173,01%	103,59%	136,01%

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	III 2007	III 2006	III 2007	III 2006	III 2007	III 2006	III 2007	III 2006
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	35,00	25,00	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	5,00	-	30,00	30,00	40,00	35,00	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2007	III 2006
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	75,00	65,00

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung
Bundesrepublik Deutschland	45,00	-	-	30,00

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2007	III 2006
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	-	-

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