

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach oben)		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach unten)	
	IV 2008	IV 2007	IV 2008	IV 2007	IV 2008	IV 2007	IV 2008	IV 2007
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	65,00	45,00	69,87	44,43	59,19	37,31	83,12	53,34
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	174,63	75,00	185,98	75,53	167,16	69,17	208,31	82,90
Überdeckung in %	168,67%	66,67%	166,16%	70,01%	182,42%	85,40%	150,62%	55,41%

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	IV 2008	IV 2007	IV 2008	IV 2007	IV 2008	IV 2007	IV 2008	IV 2007
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	65,00	35,00	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	18,28	5,00	75,38	40,00	80,97	30,00	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2008	IV 2007
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	174,63	75,00

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung	Sonstige Körperschaften des öffentlichen Rechts
Bundesrepublik Deutschland IV 2008	40,00	48,21	37,47	40,00	8,95
Bundesrepublik Deutschland IV 2007	45,00	-	-	30,00	-

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2008	IV 2007
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	-	-

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