

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach oben)		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach unten)	
	I 2009	I 2008	I 2009	I 2008	I 2009	I 2008	I 2009	I 2008
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	65,00	65,00	71,68	66,20	60,88	55,48	85,01	79,67
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	174,26	75,00	189,86	75,80	171,30	68,98	211,84	83,71
Überdeckung in %	168,09%	15,38%	164,86%	14,52%	181,35%	24,34%	149,20%	5,07%

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	I 2009	I 2008	I 2009	I 2008	I 2009	I 2008	I 2009	I 2008
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	65,00	65,00	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	18,30	-	75,46	50,00	80,50	25,00	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2009	I 2008
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	174,26	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 I 2009	40,00	47,95	37,35	40,00	8,95
Bundesrepublik Deutschland I 2008	40,00	-	-	35,00	-

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

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

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