

**I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur**

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach oben)		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach unten)	
	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	75,00	65,00	80,48	62,68	69,27	52,79	94,15	75,03
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	185,14	96,04	201,03	94,56	182,29	86,43	223,14	103,97
Überdeckung in %	146,85%	47,76%	149,78%	50,86%	163,17%	63,72%	136,99%	38,57%

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 2 Jahre		2 Jahre < x <= 3 Jahre		3 Jahr < x <= 4 Jahre	
	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	-	-	10,00	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	18,99	1,82	19,08	16,90	10,17	16,97	33,49	12,05

	4 Jahre < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008	II 2009	II 2008
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	65,00	65,00	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	15,01	12,13	88,40	36,18	-	-

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)

	II 2009	II 2008
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	185,14	96,04

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung	Sonstige Körperschaften des öffentlichen Rechts
Bundesrepublik Deutschland II 2009	40,00	58,83	37,35	40,00	8,95
Bundesrepublik Deutschland II 2008	40,00	21,04	-	35,00	-

**III) Übersicht über rückständige Forderungen**

(Angaben in Mio. Euro)

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

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