

**I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur**

(Angaben in Mio. Euro)

|                                    | Nennwert |         | Barwert |         | Stresstest *)<br>(Verschieb. 250 bp nach oben) |         | Stresstest *)<br>(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 Jahr < 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                                 | -     | -                               | -                              | -                  |