

### 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) |         |
|------------------------------------|----------|---------|---------|---------|--|---------|---|---------|
|                                    | IV 2009  | IV 2008 | IV 2009 | IV 2008 | IV 2009  | IV 2008 | IV 2009   | IV 2008 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 120,00   | 65,00   | 128,89  | 69,87   | 108,85   | 59,19   | 153,95  | 83,12   |
| Gesamtbetrag der Deckungsmassen    | 177,68   | 174,63  | 192,92  | 185,98  | 174,31   | 167,16  | 213,56  | 208,31  |
| Überdeckung in %                   | 48,06%   | 168,67% | 49,67%  | 166,16% | 60,14%   | 182,42% | 38,72%  | 150,62% |

|  | x <= 1 Jahr |         | 1 Jahr < x <= 2 Jahre |         | 2 Jahre < x <= 3 Jahre |         | 3 Jahr < x <= 4 Jahre |         |
|--|-------------|---------|-----------------------|---------|------------------------|---------|-----------------------|---------|
|  | IV 2009     | IV 2008 | IV 2009               | IV 2008 | IV 2009                | IV 2008 | IV 2009               | IV 2008 |
| Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs | -           | -       | -                     | -       | -                      | -       | 10,00                 | -       |
| Laufzeitstruktur der Deckungsmasse     | 19,54       | 3,28    | 10,27                 | 33,42   | 24,63                  | 9,09    | 25,48                 | 23,18   |

|  | 4 Jahr < x <= 5 Jahre |         | 5 Jahre < x <= 10 Jahre |         | 10 Jahre < x |         |
|--|-----------------------|---------|-------------------------|---------|--------------|---------|
|  | IV 2009               | IV 2008 | IV 2009                 | IV 2008 | IV 2009      | IV 2008 |
| Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs | -                     | -       | 75,00                   | 65,00   | 35,00        | -       |
| Laufzeitstruktur der Deckungsmasse     | 12,87                 | 24,69   | 84,89                   | 80,97   | -            | -       |

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)

|  | IV 2009 | IV 2008 |
|--|---------|---------|
| Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen | 177,68  | 174,63  |

| 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 2009                                   | 25,00      | 56,81                           | 46,91                          | 40,00                               | 8,95  |
| Bundesrepublik Deutschland IV 2008                                   | 40,00      | 48,21                           | 37,47                          | 40,00                               | 8,95  |

### III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

|   | IV 2009 | IV 2008 |
|---|---------|---------|
| Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen | -       | -       |

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