

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 2008	I 2007	I 2008	I 2007	I 2008	I 2007	I 2008	I 2007
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	65,00	35,00	66,20	35,67	55,48	29,84	79,67	43,01
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	75,00	95,00	75,80	95,49	68,98	84,82	83,71	108,11
Überdeckung in %	15,38%	171,43%	14,52%	167,73%	24,34%	184,20%	5,07%	151,35%

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	I 2008	I 2007	I 2008	I 2007	I 2008	I 2007	I 2008	I 2007
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	65,00	35,00	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	-	-	50,00	30,00	25,00	65,00	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2008	I 2007
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	75,00	95,00

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung
Bundesrepublik Deutschland	40,00	-	-	35,00

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

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

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