

Externer Report - nach Pfandbriefgesetz

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Stresstest *) (Verschieb. Nach 250 bp)		Stresstest *) (Verschieb. 250 bp nach	
	III 2006	III 2005	III 2006	III 2005	III 2006	III 2005	III 2006	III 2005
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	25,00	-	26,08	-	21,61	-	31,77	-
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	65,00	-	66,34	-	58,99	-	74,99	-
Überdeckung in %	160,00%	-	154,34%	-	173,01%	-	136,01%	-

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	III 2006	III 2005	III 2006	III 2005	III 2006	III 2005	III 2006	III 2005
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	25,00	-	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	-	-	30,00	-	35,00	-	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2006	III 2005
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	65,00	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung
Bundesrepublik Deutschland	40,00	-	-	25,00

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2006	III 2005
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	-	-

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

]

]

]

]