

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 2007	I 2006	I 2007	I 2006	I 2007	I 2006	I 2007	I 2006
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	35,00	-	35,67	-	29,84	-	43,01	-
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	95,00	-	95,49	-	84,82	-	108,11	-
Überdeckung in %	171,43%	-	167,73%	-	184,20%	-	151,35%	-

	x <= 1 Jahr		1 Jahr < x <= 5 Jahre		5 Jahre < x <= 10 Jahre		10 Jahre < x	
	I 2007	I 2006	I 2007	I 2006	I 2007	I 2006	I 2007	I 2006
Laufzeitstruktur des Pfandbriefumlaufs	-	-	-	-	35,00	-	-	-
Laufzeitstruktur der Deckungsmasse	-	-	30,00	-	65,00	-	-	-

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2007	I 2006
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	95,00	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat/Land	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Forderungen mit Gewährträgerhaftung
Bundesrepublik Deutschland	40,00	-	-	55,00

III) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2007	I 2006
Gesamtbetrag der >90 Tage rückständigen Forderungen	-	-

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