

**GESAMTBETRAG DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ÖFFENTLICHEN PFANDBRIEFE / DECKUNGSMASSE IN MIO. EURO**

	Nominal		Barwert		Risikobarwert*	
	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010
Öffentliche Pfandbriefe	33.302,91	33.313,58	37.313,72	36.889,01	34.320,78	34.213,07
Deckungsmasse	36.521,44	36.756,54	43.260,31	42.579,80	39.322,15	39.595,16
davon Derivate	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Überdeckung</b>	<b>3.218,53</b>	<b>3.442,96</b>	<b>5.946,59</b>	<b>5.690,79</b>	<b>5.001,37</b>	<b>5.382,09</b>

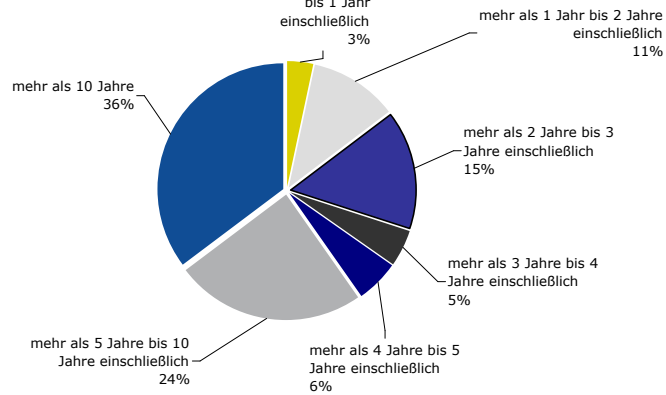
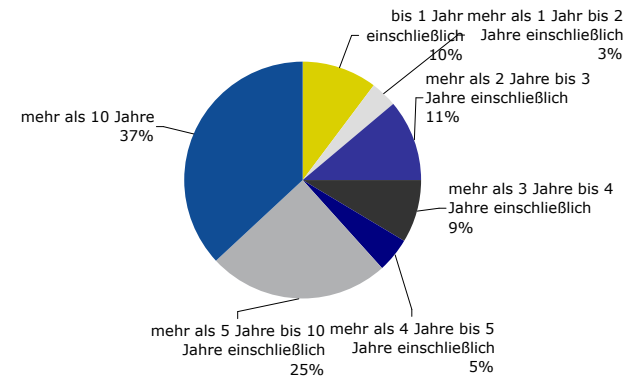
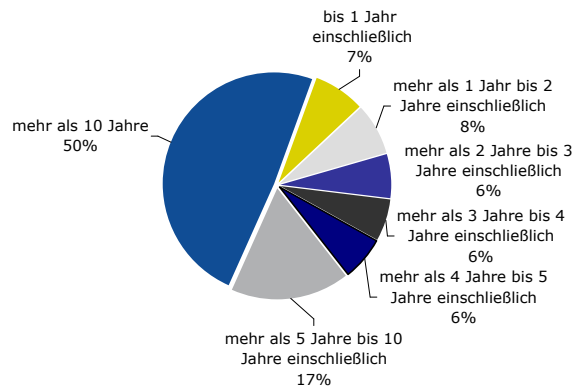
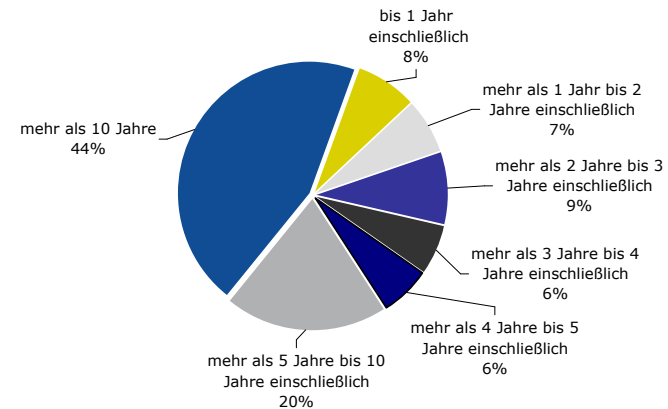
\*Risikobarwertberechnung erfolgt unter Verwendung des dynamischen Ansatzes  
Berechnung Überdeckung für Bar- und Risikobarwert incl. Zins- und Währungsstress

**GEAMTBETRAG DER DECKUNGSWERTE NACH §20 ABS. 2**

30.09.2011:	Nominal	1.944,70 Mio €
30.09.2010:	Nominal	2.753,25 Mio €

**LAUFZEITSTRUKTUR (RESTLAUFZEITEN) IN MIO. EURO**

	bis 1 Jahr einschließlich		mehr als 1 Jahr bis 2 Jahre einschließlich		mehr als 2 Jahre bis 3 Jahre einschließlich		mehr als 3 Jahre bis 4 Jahre einschließlich		mehr als 4 Jahre bis 5 Jahre einschließlich		mehr als 5 Jahre bis 10 Jahre einschließlich		mehr als 10 Jahre	
	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010
Öffentlichen Pfandbriefe	1.146,26	3.442,39	3.774,09	1.145,70	5.107,00	3.739,57	1.565,50	2.893,62	1.866,55	1.575,50	8.134,91	8.203,62	11.708,60	12.313,19
Deckungsmasse	2.690,72	2.760,18	2.834,41	2.452,57	2.261,85	3.232,28	2.301,61	2.241,22	2.287,22	2.290,20	6.327,37	7.357,21	17.818,26	16.422,87

**Laufzeitstruktur Öffentlicher Pfandbriefe 30.09.2011**

**Laufzeitstruktur Öffentlicher Pfandbriefe 30.09.2010**

**Laufzeitstruktur Deckungsstock 30.09.2011**

**Laufzeitstruktur Deckungsstock 30.09.2010**


## ZUR DECKUNG VON ÖFFENTLICHEN PFANDBRIEFEN VERWENDETE FORDERUNGEN IN MIO. EURO

	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011	30.09.2010	30.09.2011
Belgien			1.033,21	1.928,20				
Bulgarien	5,00	5,00						
Dänemark	25,00						15,00	
Deutschland	86,40	79,99	11.239,15	11.969,38	7.791,69	6.703,50	6.832,92	5.126,62
<b>dav.: mit Haftung öff. Stellen</b>							<b>5.102,04</b>	<b>4.011,27</b>
Finnland				4,50		48,72	45,00	25,00
Frankreich				23,47		67,45	320,17	132,00
Griechenland	417,00							
Großbritannien							235,00	130,00
Internationale Organisationen							353,99	353,99
Irland								
Island								
Italien	817,11	1.878,36	1.122,14	947,43	307,53	825,73	347,98	
Japan	553,51	610,37	5,00	148,28		128,77		
Kanada					52,00	14,89	35,00	
Litauen	25,00	25,00						
Luxemburg							40,00	40,00
Niederlande								
Norwegen							65,00	25,00
Österreich	75,22	75,22	1.724,60	1.726,80	10,00	10,00	123,25	198,25
Polen	170,00	250,00						
Portugal	25,00	225,00	275,00	75,00			15,00	64,52
Rumänien	5,00							
Schweden						243,93		
Schweiz			112,36				74,90	82,10
Slowenien	10,00							
Spanien	18,74	18,74	305,80	503,90	201,60	168,10	955,70	1.012,30
Tschechische Rep.	225,00							
Ungarn	277,49	278,12						
USA			285,62	290,39	56,46	57,41		
Zypern	40,00							

Auf die Deckungswerte der öffentlichen Pfandbriefe sind keine Leistungen mehr als 90 Tage rückständig.