

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

	Nominal		Barwert		Risikobarwert*	
	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010
Öffentliche Pfandbriefe	34.127,63	33.869,40	35.769,35	36.867,71	33.211,45	34.462,70
Deckungsmasse	37.601,74	37.273,93	41.497,07	42.478,93	38.824,06	39.720,40
davon Derivate	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Überdeckung	3.474,11	3.404,53	5.727,72	5.611,22	5.612,61	5.257,70

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

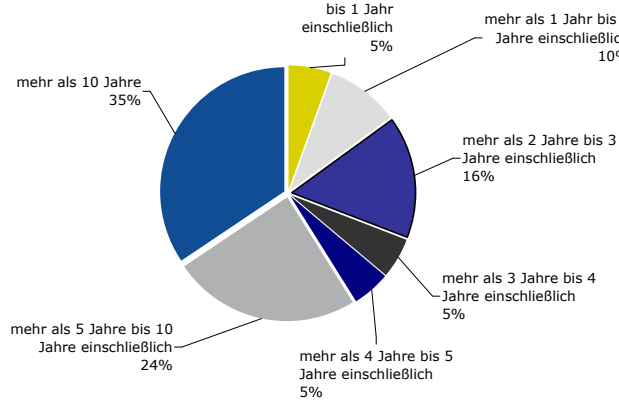
GEAMTBETRAG DER DECKUNGSWERTE NACH §20 ABS. 2

30.06.2011:	Nominal	2.348,34 Mio €
30.06.2010:	Nominal	3.110,08 Mio €

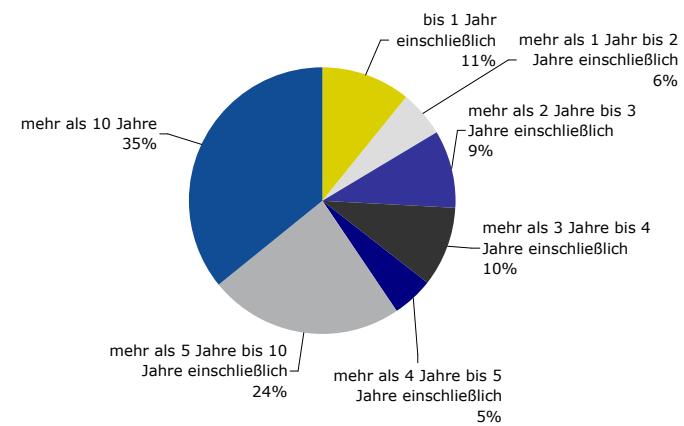
LAUFZEITSTRUKTUR (RESTLAUFZEITEN) IN MIO. EURO

	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	
	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010
Öffentlichen Pfandbriefe	1.865,47	3.700,21	3.247,06	1.874,92	5.455,23	3.207,79	1.727,30	3.254,52	1.736,05	1.737,30	8.302,26	7.962,26	11.794,26	12.132,41
Deckungsmasse	2.588,03	2.014,16	3.713,84	2.689,18	2.375,23	3.738,94	2.075,20	2.352,27	2.962,53	2.036,45	6.610,16	8.586,78	17.276,75	15.856,14

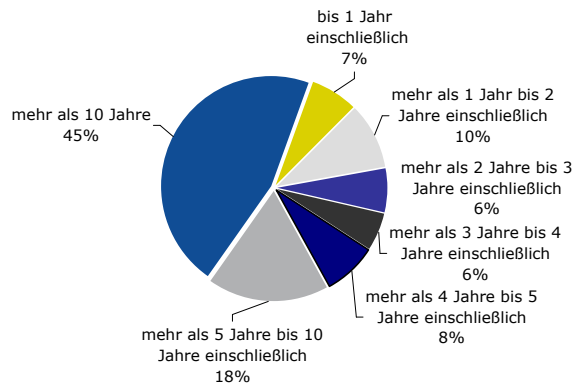
Laufzeitstruktur Öffentlicher Pfandbriefe 30.06.2011



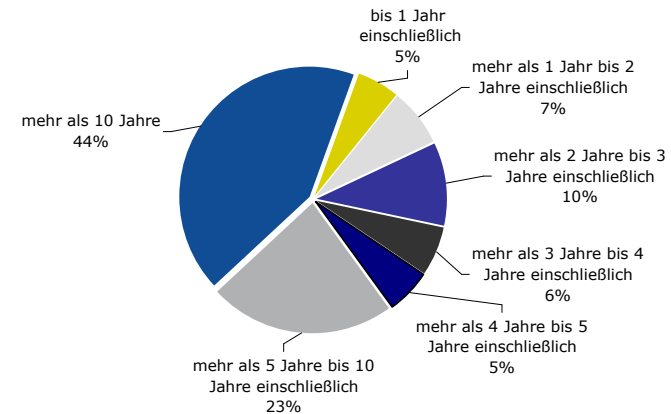
Laufzeitstruktur Öffentlicher Pfandbriefe 30.06.2010



Laufzeitstruktur Deckungsstock 30.06.2011



Laufzeitstruktur Deckungsstock 30.06.2010



ZUR DECKUNG VON ÖFFENTLICHEN PFANDBRIEFEN VERWENDETE FORDERUNGEN IN MIO. EURO

	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011	30.06.2010	30.06.2011
Belgien			368,06	1.947,94				
Bulgarien	5,00	5,00						
Dänemark	25,00						15,00	15,00
Deutschland	89,61	83,19	11.698,82	12.292,13	7.981,10	7.218,25	6.985,88	5.448,16
dav.: mit Haftung öff. Stellen							4.323,38	4.014,65
Finnland				5,25		49,87	45,00	25,00
Frankreich					6,70		355,80	307,00
Griechenland	417,00							
Großbritannien							270,00	160,00
Internationale Organisationen							353,99	353,99
Irland								
Island								
Italien	1.071,07	1.391,29	1.103,53	954,81	46,32	829,42	344,39	179,48
Japan	579,81	538,87	5,00	131,50		113,68		
Kanada					57,88	13,80	35,00	
Litauen	25,00	25,00						
Luxemburg							40,00	40,00
Niederlande							114,97	
Norwegen							65,00	45,00
Österreich	75,23	75,22	1.720,88	1.718,95	10,00	10,00	123,25	218,25
Polen	270,00	250,00						
Portugal	25,00	225,00	200,00	75,00	75,00		15,00	62,82
Rumänien	40,00	5,00						
Schweden						155,67		
Schweiz			113,07				75,38	81,76
Slowenien	10,00							
Spanien	18,74	18,74	352,80	513,90	154,60	178,10	940,70	979,20
Tschechische Rep.	225,00	225,00						
Ungarn	283,56	273,17						
USA			317,94	269,11	62,85	53,21	20,00	
Zypern	40,00	40,00						

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