



Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte in Mio. €

| GESAMTBETRAG DER IM UMLAUF BEFINDLICHEN ÖFFENTLICHEN PFANDBRIEFE / DECKUNGSMASSE IN MIO. EURO | | | | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------------|----------------|
| | Nominal | | Barwert | | Risikobarwert* | |
| | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 |
| Öffentliche Pfandbriefe | 35.302,3 | 38.777,4 | 37.175,9 | 38.048,8 | 33.910,8 | 36.358,0 |
| Deckungsmasse | 36.925,8 | 40.444,7 | 40.382,2 | 41.960,2 | 36.908,8 | 39.569,8 |
| davon Derivate | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Überdeckung | 1.623,5 | 1.667,3 | 3.206,3 | 3.911,4 | 2.998,0 | 3.211,8 |

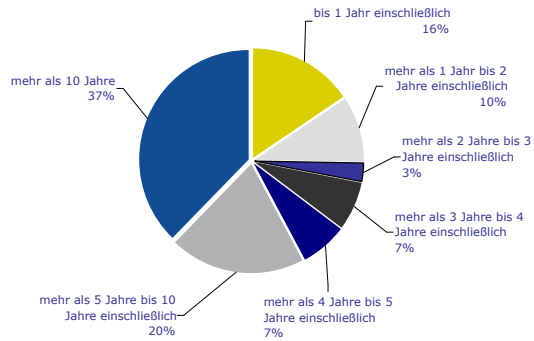
*Risikobarwertberechnung erfolgt unter Verwendung des dynamischen Ansatzes

** Berechnung Überdeckung für Bar- und Risikobarwert incl. Zins- und Währungsstress

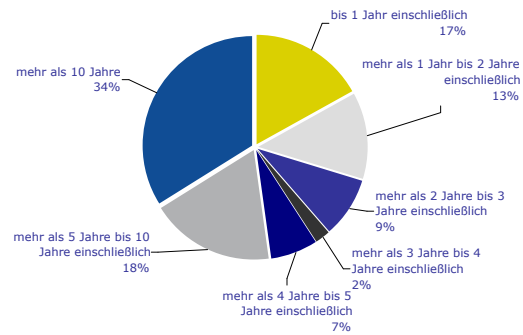


| LAUFZEITSTRUKTUR (RESTLAUFZEITEN) IN MIO. EURO | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---------------------------|------------|--|------------|---|------------|---|------------|---|------------|--|------------|-------------------|------------|
| | bis 1 Jahr einschließlich | | mehr als 1 Jahr bis 2 Jahre 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 | |
| | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.06.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 |
| Öffentlichen Pfandbriefe | 5.518,6 | 6.551,8 | 3.442,3 | 4.972,1 | 971,0 | 3.407,1 | 2.549,6 | 946,5 | 2.381,4 | 2.641,0 | 7.092,2 | 7.088,0 | 13.347,3 | 13.171,0 |
| Deckungsmasse | 1.685,6 | 3.463,6 | 2.737,4 | 1.839,0 | 2.573,0 | 2.471,4 | 2.635,4 | 2.559,3 | 2.212,2 | 2.809,2 | 8.543,7 | 10.832,2 | 16.538,4 | 16.470,2 |

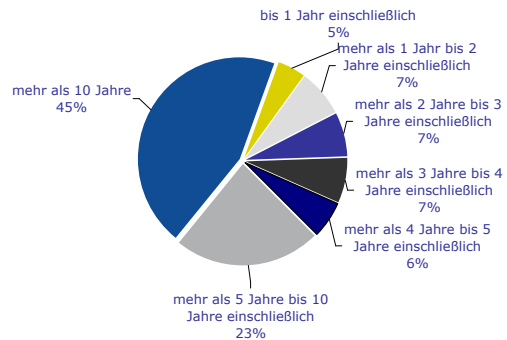
Laufzeitstruktur Öffentlicher Pfandbriefe 30.09.2009



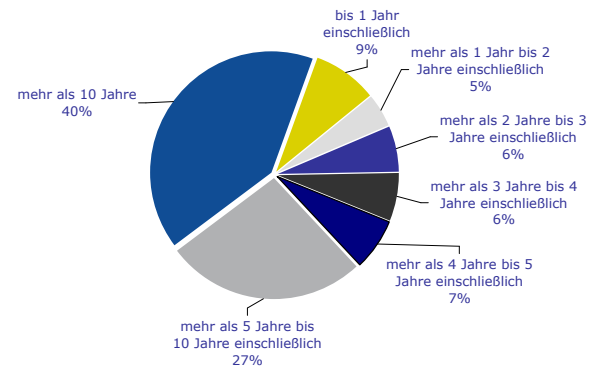
Laufzeitstruktur Öffentlicher Pfandbriefe 30.09.2008



Laufzeitstruktur Deckungsstock 30.09.2009



Laufzeitstruktur Deckungsstock 30.09.2008



ZUR DECKUNG VON ÖFFENTLICHEN PFANDBRIEFEN VERWENDETE FORDERUNGEN IN MIO. EURO

| | Staat | | Regionale Gebietskörperschaften | | Örtliche Gebietskörperschaften | | Sonstige Schuldner | |
|-------------------|------------|------------|------------------------------------|------------|-----------------------------------|------------|--------------------|------------|
| | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 | 30.09.2008 | 30.09.2009 |
| Belgien | | | 45,00 | 45,00 | | | 175,00 | |
| Bulgarien | 5,00 | 5,00 | | | | | | |
| Dänemark | | 25,00 | | | | | 65,00 | 40,00 |
| Deutschland | 51,13 | 51,13 | 11.454,19 | 12.345,49 | 9.504,85 | 8.170,87 | 10.262,53 | 6.956,22 |
| Finnland | | | | | | | 20,00 | 45,00 |
| Frankreich | | | | | 12,70 | 12,70 | 904,56 | 411,35 |
| Griechenland | 848,00 | 637,00 | | | | | | |
| Intern. Inst. | | | | | | | 405,23 | 389,49 |
| Irland | | | | | | | 200,00 | 30,00 |
| Island | 10,00 | | | | | | 10,00 | |
| Italien | 1.114,08 | 478,57 | 8,05 | 1.458,24 | | 48,42 | 175,43 | 334,14 |
| Japan | 423,03 | 481,30 | 5,00 | 5,00 | | | | |
| Kanada | | | | | 68,59 | 48,58 | | 35,00 |
| Litauen | 25,00 | 25,00 | | | | | | |
| Luxemburg | | | | | | | 50,00 | 40,00 |
| Niederlande | | | | | | | 230,97 | 159,97 |
| Norwegen | | | | | | | 100,00 | 65,00 |
| Österreich | 75,22 | 75,22 | 1.002,24 | 1.729,52 | | 10,00 | 825,60 | 243,25 |
| Polen | 270,00 | 270,00 | | | | | | |
| Portugal | 125,00 | 25,00 | 275,00 | 275,00 | | | | 34,00 |
| Rumänien | 40,00 | 40,00 | | | | | | |
| Schweden | | | | | | | | 35,00 |
| Schweiz | 10,00 | | 95,24 | 98,79 | | | 63,49 | 65,87 |
| Slowenien | | 10,00 | | | | | | |
| Spanien | | 18,74 | | 100,00 | 2,00 | 2,00 | 375,24 | 396,50 |
| Tschechische Rep. | 225,00 | 225,00 | | | | | | |
| Ungarn | 288,01 | 271,92 | | | | | | |
| United Kingdom | | | | | | | 205,00 | 270,00 |
| USA | | | 272,25 | 266,84 | 62,14 | 59,73 | 20,00 | 20,00 |
| Zypern | 40,00 | 40,00 | | | | | | |

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