

Transparenzvorschriften gem. §28 Abs. 1 Nr. 1 bis 3 PfandBG per 31.03.2007

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte in Mio. €

Gesamtbetrag der in Umlauf befindlichen	Nominal	Barwert	Risikobarwert*
	31.03.2007	31.03.2007	31.03.2007
Hypothekendarlehen	0,0	0,0	0,0
Deckungsmasse	0,0	0,0	0,0
davon Derivate	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	0,0	0,0	0,0

Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)	Berichtsjahr			
		mehr als 1 Jahr bis	Mehr als 5 Jahre bis	
	bis einschl. 1 Jahr	bis einschl. 5 Jahre	bis einschl. 10 Jahre	länger als 10 Jahre
Hypothekendarlehen	0,0	0,0	0,0	0,0
Deckungsmasse**	0,0	0,0	0,0	0,0

Gesamtbetrag der in Umlauf befindlichen	Nominal	Barwert	Risikobarwert*
	31.03.2007	31.03.2007	31.03.2007
Öffentlichen Darlehen	33.604,6	33.245,9	31.320,4
Deckungsmasse	35.695,0	37.441,5	35.103,2
davon Derivate	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	2.090,4	4.195,6***	3.782,8***

Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)	Berichtsjahr			
		mehr als 1 Jahr bis	mehr als 5 Jahre bis	
	bis einschl. 1 Jahr	bis einschl. 5 Jahre	bis einschl. 10 Jahre	länger als 10 Jahre
Öffentlichen Darlehen	4.181,5	11.638,3	5.642,8	12.142,0
Deckungsmasse	3.358,8	6.508,8	12.689,8	13.137,6

*Risikobarwertberechnung erfolgt unter Verwendung des dynamischen Ansatzes

**Deckungsmasse der Hypothekendarlehen besteht ausschließlich in Form von Ersatzdeckung durch Wertpapiere

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

Zur Deckung von öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen in Mio. €

	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
Belgien		45,0		175,0
Dänemark				65,0
Deutschland	254,5	8.967,2	8.324,1	10.586,4
Finnland				20,0
Frankreich			12,7	269,0
Griechenland	549,0			
Intern. Inst.				418,2
Irland				300,0
Island	10,0			10,0
Italien	907,3			120,8
Japan	400,6			
Kanada			71,8	
Litauen	25,0			
Luxemburg				40,0
Niederlande				166,4
Norwegen				100,0
Österreich	58,8	1.006,3		763,3
Polen	143,0			
Portugal	150,0		275,0	
Schweiz		92,3		
Spanien			2,0	665,2
Tschechische Rep.	125,0		50,0	
Ungarn	219,3			
United Kingdom				155,0
USA		67,6	44,2	
Zypern	40,0			

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