



Hypothekengeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß § 28 PfandBG

Stand: 30.06.2007

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €)

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	4.899,5	4.262,6	636,9
Barwert	5.065,4	4.185,7	879,7

Anteil Derivate an der Deckungsmasse: - 0,81% (Stichtag)

Risikobarwert der Überdeckung: 730,4 (Stichtag)

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	4.013,0	2.910,1	1.103,0
Barwert	4.173,2	2.923,8	1.249,4

Anteil Derivate an der Deckungsmasse: 0,20% (Stichtag)

Risikobarwert der Überdeckung: 1.123,1 (Stichtag)

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio. €)

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	465,4	272,5
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.629,9	2.782,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.572,7	1.207,7
mehr als 10 Jahre	231,5	0,0
Total	4.899,5	4.262,6

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	268,4	105,1
mehr als 1 bis 5 Jahre	1.925,1	1.583,9
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.631,7	1.221,1
mehr als 10 Jahre	187,8	0,0
Total	4.013,0	2.910,1

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio. €)

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	143,0
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	563,3
über 5 Mio. €	4.193,3
Total	4.899,5

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	190,3
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	523,1
über 5 Mio. €	3.299,6
Total	4.013,0

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch für den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen von mindestens 90 Tagen.