



Hypothekengeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß § 28 PfandBG

Stand: 30.09.2006

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	4.011,4	2.949,2	1.062,2
Barwert	4.196,1	3.020,3	1.175,7

Anteil Derivate an der Deckungsmasse: - 0,04%

Risikobarwert der Überdeckung: 1.067,6

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	247,2	131,6
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.085,6	1.635,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.492,4	1.181,9
mehr als 10 Jahre	186,2	0,0
Total	4.011,4	2.949,2

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	177,9
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	518,8
über 5 Mio. €	3.314,7
Total	4.011,4

Anmerkung: Für den Berichtszeitraum existieren keine mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen