



Hypothekengeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß § 28 PfandBG

Stand: 30.06.2006

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

	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: 0,2%

Risikobarwert der Überdeckung: 1.123,1

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

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

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