

Gemäß "§28 Transparenzvorschriften" des Pfandbriefgesetzes sind Pfandbriefbanken verpflichtet, quartalsweise in öffentlich zugänglicher Form sowie im Anhang des Jahresabschlusses folgende, jeweils auf das Quartalsende bezogene Angaben zu veröffentlichen:

30. Juni 2008

"Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie der entsprechenden Deckungsmassen in Höhe des Nennwertes, des Barwertes sowie des in der Rechtsverordnung nach § 4 Abs. 6 festgelegten Risikobarwertes"

in Mio EUR *	Nennwert	Barwert	Risikobarwert (including Interest and FX risk)	
			Dynamic downshift	Dynamic upshift
Öffentliche Pfandbriefe	42.789	(42.438)	(44.987)	(38.780)
Deckungsmasse	44.550	45.525	48.032	41.029
Überdeckung (+), Unterdeckung (-)	1.761	3.087	3.045	2.249
Überdeckung in %	4,12%	7,27%	6,77%	5,80%

*per 30. Juni 2008

"Laufzeitstruktur der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen, jeweils in Stufen von bis zu einem Jahr, von mehr als einem Jahr bis zu fünf Jahren, von mehr als fünf Jahren bis zu zehn Jahren und von mehr als zehn Jahren"

in Mio EUR *	Laufzeitstruktur nach Restlaufzeit*			
	< 1 Jahr	1 bis 5 Jahre	5 bis 10 Jahre	> 10 Jahre
Öffentlichen Pfandbriefe (Nominal)	8.625	20.198	6.016	7.950
in Mio EUR *	Deckungsmasse nach Zinsbindungsfristen*			
	< 1 Jahr	1 bis 5 Jahre	5 bis 10 Jahre	> 10 Jahre
Deckungsmasse (Nominal)	21.188	9.288	4.775	9.308

*ohne Derivate

*per 30. Juni 2008

"Anteil der Derivate an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 4 Satz 3, auch in Verbindung mit § 20 Abs. 2 Nr. 3 und § 26 Abs. 1 Nr. 4."

in Mio EUR *	Barwert	%
Anteil der Derivate mit negativem Barwert an den Verbindlichkeiten	-63	0,15%
Anteil der Derivate mit positivem Barwert an der Deckungsmasse	6	0,01%

*per 30. Juni 2008

"Für den Gesamtbetrag der zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen sind zusätzlich anzugeben: verteilt auf die einzelnen Staaten, in denen die Schuldner und im Falle einer vollen Gewährleistung die gewährleistenden Stellen ihren Sitz haben, die nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge, der Art nach zusätzlich danach aufgeschlüsselt, ob sich die Forderung gegen den Staat, regionale Gebietskörperschaften, örtliche Gebietskörperschaften oder sonstige Schuldner richtet oder von diesen jeweils voll gewährleistet ist"

Staaten	Beträge in MEUR *			
	Staat	regionale Gebietskörperschaften	örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
Deutschland	226.69	7135.61	106.87	6678.71
Supranational	110.00	0.00	0.00	1018.80
Osterreich	3093.77	0.00	0.00	1916.90
Belgien	313.33	35.00	0.00	245.61
Kanada	0.00	294.34	0.00	18.66
Tschechische Republik	0.00	0.00	0.00	95.00
Dänmark	0.00	0.00	0.00	88.53
Finnland	106.27	0.00	0.00	6.34
Frankreich	1343.84	0.00	0.00	3060.97
Griechenland	1775.68	0.00	0.00	1262.03
Ungarn	333.88	0.00	0.00	0.00
Island	0.00	0.00	0.00	0.00
Irland	0.00	0.00	0.00	0.00
Italien	2875.33	2234.72	269.82	0.00
Japan	0.00	0.00	85.63	171.51
Liechtenstein	0.00	0.00	0.00	0.00
Luxemburg	0.00	0.00	0.00	0.00
Mexiko	0.00	0.00	0.00	0.00
Niederlande	0.00	0.00	0.00	0.00
Neuseeland	0.00	0.00	0.00	0.00
Norwegen	0.00	0.00	0.00	0.00
Polen	718.17	0.00	0.00	0.00
Portugal	338.32	193.53	0.00	1082.94
Slowakische Republik	0.00	0.00	0.00	245.00
Süd Korea	0.00	0.00	0.00	0.00
Spanien	240.00	859.66	473.92	101.12
Schweden	0.00	0.00	0.00	42.06
Schweiz	0.00	499.17	0.00	249.13
Türkei	0.00	0.00	0.00	0.00
Großbritannien	0.00	143.89	148.94	252.45
USA	24.58	523.61	260.11	44.25
Ersatzdeckung	0.00	0.00	0.00	3215.00

*per 30. Juni 2008

"Der Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen auf diese Forderungen und dessen regionale Verteilung"

90 Tage rückständigen Leistungen in Mio EUR *	Betrag	%
Summe:	0	0
Regionale Verteilung:		
n.a.	0	0

*per 30. Juni 2008

Gemäß "§28 Transparenzvorschriften" des Pfandbriefgesetzes sind Pfandbriefbanken verpflichtet, quartalsweise in öffentlich zugänglicher Form sowie im Anhang des Jahresabschlusses folgende, jeweils auf das Quartalsende bezogene Angaben zu veröffentlichen:

"Für sämtliche Angaben ... ist in den Veröffentlichungen ... ab dem 01. Januar 2007 jeweils auch der entsprechende Wert des Vorjahres anzugeben"

30. Juni 2007

"Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie der entsprechenden Deckungsmassen in Höhe des Nennwertes, des Barwertes sowie des in der Rechtsverordnung nach § 4 Abs. 6 festgelegten Risikobarwertes"

in Mio EUR *	Nennwert	Barwert	Risikobarwert (including Interest and FX risk)	
			Dynamic downshift	Dynamic upshift
Öffentliche Pfandbriefe	47.411	(47.501)	(49.390)	(44.502)
Deckungsmasse	49.073	50.382	52.858	46.758
Überdeckung (+), Unterdeckung (-)	1.661	2.881	3.468	2.256
Überdeckung in %	3.50%	6.07%	7.02%	5.07%

*per 29.Juni 2007

"Laufzeitstruktur der im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen, jeweils in Stufen von bis zu einem Jahr, von mehr als einem Jahr bis zu fünf Jahren, von mehr als fünf Jahren bis zu zehn Jahren und von mehr als zehn Jahren"

in Mio EUR *	Laufzeitstruktur (Restlaufzeit)*			
	< 1 Jahr	1 bis 5 Jahre	5 bis 10 Jahre	> 10 Jahre
Öffentlichen Pfandbriefe (Nominal)	8.735	22.866	6.515	9.295
	Deckungsmasse nach Zinsbindungsfristen*			
	< 1 Jahr	1 bis 5 Jahre	5 bis 10 Jahre	> 10 Jahre
Deckungsmasse (Nominal)	19.448	12.465	5.216	11.944

*ohne Derivate

*per 29.Juni 2007

"Anteil der Derivate an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 Nr. 4 Satz 3, auch in Verbindung mit § 20 Abs. 2 Nr. 3 und § 26 Abs. 1 Nr. 4."

in Mio EUR *	Barwert	%
Anteil des Barwertes der Derivate an den Verbindlichkeiten	-	0.00%
Anteil des Barwertes der Derivate an der Deckungsmasse	-	0.00%

*per 29.Juni 2007

"Für den Gesamtbetrag der zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendeten Forderungen sind zusätzlich anzugeben: verteilt auf die einzelnen Staaten, in denen die Schuldner und im Falle einer vollen Gewährleistung die gewährleistenden Stellen ihren Sitz haben, die nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge, der Art nach zusätzlich danach aufgeschlüsselt, ob sich die Forderung gegen den Staat, regionale Gebietskörperschaften, örtliche Gebietskörperschaften oder sonstige Schuldner richtet oder von diesen jeweils voll gewährleistet ist"

Staaten	Beträge in MEUR *			
	Staat	regionale Gebietskörperschaften	örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
Deutschland	1068.07	9218.14	498.64	7829.81
Supranational	0.00	0.00	0.00	862.97
Österreich	3025.57	626.49	0.00	1704.26
Belgien	313.20	0.00	0.00	141.66
Kanada	0.00	338.27	0.00	58.91
Tschechische Republik	0.00	0.00	0.00	45.00
Dänmark	0.00	75.00	0.00	94.47
Finnland	30.01	0.00	0.00	7.40
Frankreich	1310.98	0.00	0.00	3358.52
Griechenland	1409.52	0.00	0.00	853.70
Ungarn	122.00	0.00	0.00	0.00
Island	0.00	0.00	0.00	0.00
Irland	0.00	0.00	0.00	0.00
Italien	3814.31	979.72	18.88	0.00
Japan	0.00	0.00	89.24	200.38
Liechtenstein	0.00	0.00	0.00	0.00
Luxemburg	0.00	0.00	0.00	110.00
Mexiko	0.00	0.00	0.00	0.00
Niederlande	0.00	0.00	0.00	291.45
Neuseeland	0.00	0.00	0.00	0.00
Norwegen	0.00	0.00	0.00	0.00
Polen	1385.08	0.00	0.00	0.00
Portugal	468.75	249.80	0.00	913.81
Slowakische Republik	0.00	0.00	0.00	245.00
Süd Korea	0.00	0.00	0.00	0.00
Spanien	240.00	613.79	209.02	61.58
Schweden	0.00	0.00	0.00	42.01
Schweiz	0.00	395.30	0.00	241.65
Türkei	0.00	0.00	0.00	0.00
Großbritannien	0.00	175.07	175.07	470.35
USA	56.14	443.90	126.80	387.94
Ersatzdeckung	0.00	0.00	0.00	3675.00

*per 29.Juni 2007

"Der Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen auf diese Forderungen und dessen regionale Verteilung"

90 Tage rückständigen Leistungen in Mio EUR *	Betrag	%
Summe:	0	0
Regionale Verteilung:		
n.a.	0	0

*per 29.Juni 2007