

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. September 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	42.537	(42.781)	(45.395)	(38.538)
Deckungsmasse	44.479	46.125	48.861	40.889
Überdeckung (+), Unterdeckung (-)	1.941	3.344	3.466	2.351
Überdeckung in %	4.56%	7.82%	7.64%	6.10%

*per 30. September 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)	7.740	20.623	6.247	7.928
Deckungsmasse (Nominal)	Deckungsmasse nach Zinsbindungsfristen*			
	< 1 Jahr	1 bis 5 Jahre	5 bis 10 Jahre	> 10 Jahre
	20.455	9.270	5.278	9.476

*ohne Derivate

*per 30. September 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	-15	0.04%
Anteil der Derivate mit positivem Barwert an der Deckungsmasse	41	0.08%

*per 30. September 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 Gebietskörper- schaften	örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
Deutschland	150.00	7076.20	84.75	6292.70
Supranational	110.00	0.00	0.00	1001.99
Osterreich	3531.62	0.00	0.00	1609.55
Belgien	426.09	110.00	0.00	245.61
Kanada	0.00	314.39	0.00	20.59
Tschechische Republik	0.00	0.00	0.00	95.00
Dänmark	0.00	0.00	0.00	92.43
Finnland	109.45	0.00	101.25	6.99
Frankreich	283.06	0.00	0.00	3324.52
Griechenland	2505.08	0.00	0.00	1557.03
Ungarn	344.21	0.00	0.00	0.00
Italien	3530.13	2062.56	266.66	0.00
Japan	0.00	0.00	87.96	189.63
Polen	668.32	0.00	0.00	0.00
Portugal	338.40	93.53	0.00	1262.94
Slowakische Republik	0.00	0.00	0.00	245.00
Spanien	0.00	614.28	273.92	101.21
Schweden	0.00	0.00	0.00	46.52
Schweiz	0.00	513.40	0.00	253.58
Großbritannien	0.00	144.25	130.33	253.07
USA	27.09	543.51	283.18	71.54
Ersatzdeckung	0.00	0.00	0.00	3085.00

*per 30. September 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

*per 30. September 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"

28. September 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	44.637	44.903	46.670	41.898
Deckungsmasse	46.194	47.696	49.624	44.407
Überdeckung (+), Unterdeckung (-)	1.557	2.793	2.954	2.509
Überdeckung in %	3.49%	6.22%	6.33%	5.99%

*per 28. September 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)	8.653	19.755	6.196	7.831
	Deckungsmasse nach Zinsbindungsfristen*			
	< 1 Jahr	1 bis 5 Jahre	5 bis 10 Jahre	> 10 Jahre
Deckungsmasse (Nominal)	20.152	9.994	4.227	9.865

*ohne Derivate

*per 28. September 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 28. September 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	8785.20	495.23	6782.88
Supranational	0.00	0.00	0.00	593.28
Österreich	3106.42	626.49	0.00	1615.34
Belgien	315.46	0.00	0.00	263.46
Kanada	0.00	230.98	0.00	380.82
Tschechische Republik	0.00	0.00	0.00	45.00
Dänmark	0.00	0.00	0.00	92.49
Finnland	106.80	0.00	0.00	7.05
Frankreich	1310.98	0.00	0.00	3176.60
Griechenland	1719.92	0.00	0.00	997.03
Ungarn	122.23	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	2877.40	2073.46	18.88	0.00
Japan	0.00	0.00	88.00	176.55
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	0.00
Neuseeland	0.00	0.00	0.00	0.00
Norwegen	0.00	0.00	0.00	0.00
Polen	725.36	0.00	0.00	0.00
Portugal	467.56	293.53	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	708.44	371.00	61.67
Schweden	0.00	0.00	0.00	42.80
Schweiz	0.00	485.82	0.00	240.95
Türkei	0.00	0.00	0.00	0.00
Großbritannien	0.00	163.61	169.35	360.71
USA	53.47	422.80	120.77	366.56
Ersatzdeckung	0.00	0.00	0.00	2555.00

*per 28. September 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 28. September 2007