



Hypothekengeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß § 28 PfandBG

Stand: 31.12.2006

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	4.271,7	3.119,3	1.152,4
Barwert	4.434,2	3.172,8	1.261,4

Anteil Derivate an der Deckungsmasse: - 0,11%

Risikobarwert der Überdeckung: 1.125,8

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	309,9	171,6
mehr als 1 bis 5 Jahre	2.331,5	1.782,7
mehr als 5 bis 10 Jahre	1.444,7	1.165,0
mehr als 10 Jahre	185,6	0,0
Total	4.271,7	3.119,3

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

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T €	167,0
mehr als 300T € bis 5 Mio. €	516,2
über 5 Mio. €	3.588,5
Total	4.271,7

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