



Kommunalgeschäft - Übersicht zur Deckungsmasse gemäß §28 PfandBG

Stand: 30.09.2007

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

	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf	Überdeckung
Nennwert	3.384,8	3.081,6	303,2
Barwert	3.395,2	3.069,3	325,8
davon Derivate	3,4	3,9	

	Stichtag
Anteil weitere Deckungswerte	4,5
Risikobarwert* der Überdeckung	250,9

* dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe in Umlauf Vorjahr	Überdeckung
Nennwert	3.167,3	2.611,2	556,2
Barwert	3.399,0	2.773,5	625,6
davon Derivate	-	-	

	Vorjahr
Anteil weitere Deckungswerte	0,0
Risikobarwert* der Überdeckung	574,8

* dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

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

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	201,8	195,0
mehr als 1 bis 5 Jahre	775,1	504,2
mehr als 5 bis 10 Jahre	956,7	1.063,6
mehr als 10 Jahre	1.451,1	1.318,9
Total	3.384,8	3.081,6

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe in Umlauf
bis 1 Jahr	255,9	6,0
mehr als 1 bis 5 Jahre	832,3	399,4
mehr als 5 bis 10 Jahre	787,1	971,1
mehr als 10 Jahre	1.292,0	1.234,7
Total	3.167,3	2.611,2

Verteilung der nennwertig als Deckung für Öffentliche Pfandbriefe verwendeten Forderungen auf die einzelnen Staaten, in denen der Schuldner bzw. die gewährleistende Stelle ihren Sitz hat - aufgeschlüsselt nach § 28 III Nr. 1 (Mio. €)

Länder	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Gesamt
		regionale	örtliche		
Deutschland	270,0	1.725,4	-	821,0	2.816,4
Italien	164,0	-	-	-	164,0
Frankreich	-	-	-	43,1	43,1
Großbritannien	-	-	-	7,5	7,5
Österreich	124,2	25,0	-	20,0	169,2
Spanien	-	95,0	35,0	4,5	134,5
Schweiz	-	50,0	-	-	50,0
Total	558,2	1.895,4	35,0	896,1	3.384,8

Werte des Vorjahres gemäß § 28 Abs. 5

Länder	Staat	Gebietskörperschaft		Sonstige	Gesamt
		regionale	örtliche		
Deutschland	325,0	1.646,3	-	776,7	2.748,0
Italien	210,0	-	-	-	210,0
Frankreich	-	-	-	30,1	30,1
Österreich	124,2	-	-	20,0	144,2
Spanien	-	-	35,0	-	35,0
Total	659,2	1.646,3	35,0	826,8	3.167,3

Anmerkung: Weder für den Berichtszeitraum noch für den vergleichbaren Vorjahreszeitraum existieren rückständige Leistungen