

Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

I) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG zum Gesamtbetrag (Angaben in Tsd. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten)	
	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	10.000	18.123	10.096	15.062	8.264	21.393	12.447
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	36.696	31.659	39.609	31.486	34.020	27.439	46.035	36.775
davon gattungsklassische Deckungswerte	34.696	29.659	37.540	29.526	32.093	25.652	43.893	34.619
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.069	1.961	1.927	1.788	2.143	2.156
Überdeckung in %	129,35%	216,59%	118,55%	211,86%	125,86%	232,03%	115,19%	195,45%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,42%					

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

II) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11
bis einschließlich 1 Jahr	4.516	1.693	0	0	4.516	1.693
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	403	4.601	0	0	403	4.601
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.222	412	0	0	2.222	412
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	1.417	2.246	0	0	1.417	2.246
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.457	1.476	0	0	2.457	1.476
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	14.003	11.708	16.000	10.000	-1.997	1.708
über 10 Jahre	11.678	9.523	0	0	11.678	9.523

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

	30.03.12		30.03.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.03.12		30.03.11	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	36.696	31.659							
weitere Deckungen										
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto							0,00%		0,00%	
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut							0,00%		0,00%	
Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen										
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner			
	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11
Deutschland	0	0	2.000	2.000	34.696	29.659	0	0	0	0

IV) Übersicht über rückständige gattungsklassische Deckungswerte (Angaben in Tsd. Euro)

	30.03.12		30.03.11		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	0										
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen												
	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11	30.03.12	30.03.11
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

Erläuterungen zu den im Report verwendeten Begriffen

Gattungsklassische Deckungswerte:	- Darlehnsforderungen
Sonstige Deckungswerte:	- weitere Deckungswerte nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG - sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG - Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG
Weitere Deckungswerte:	- nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG
Sichernde Überdeckung:	- nach § 4 Abs. 1 PfandBG
Liquiditätssicherung:	- nach § 4 Abs. 1a PfandBG