

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)	
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	15.000	19.027	16.772	15.939	13.819	21.207	20.464
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	36.195	31.332	40.320	33.176	34.763	28.904	45.163	38.493
davon gattungsklassische Deckungswerte	34.195	29.332	38.203	31.109	32.769	26.999	43.020	36.303
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.117	2.066	1.995	1.904	2.143	2.190
Überdeckung in %	126,22%	108,88%	111,91%	97,80%	118,11%	109,16%	112,96%	88,11%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,13%					

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	
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
bis einschließlich 1 Jahr	4.472	1.685	0	0	4.472	1.685
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	608	4.559	0	0	608	4.559
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.000	642	0	0	2.000	642
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	1.388	2.000	0	0	1.388	2.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.414	1.447	0	0	2.414	1.447
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.820	11.554	16.000	15.000	-2.180	-3.446
über 10 Jahre	11.493	9.445	0	0	11.493	9.445

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	28.09.12		28.09.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		28.09.12		28.09.11	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	36.195	31.332							
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			
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Deutschland	0	0	2.000	2.000	34.195	29.332	0	0	0	0

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

	28.09.12		28.09.11							
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	0							
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen										
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner			
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Deutschland	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