

## 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)	
	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	19.361	18.108	16.302	15.030	21.184	21.763
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.414	31.192	35.625	33.419	30.164	29.218	39.923	38.434
davon gattungsklassische Deckungswerte	29.414	29.192	33.500	31.325	28.149	27.276	37.780	36.244
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.125	2.094	2.014	1.941	2.143	2.190
Überdeckung in %	96,34%	94,95%	84,01%	84,55%	85,03%	94,39%	88,46%	76,60%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,98%					

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	
	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11
bis einschließlich 1 Jahr	0	1.677	0	0	0	1.677
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	590	4.559	0	0	590	4.559
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.000	642	0	0	2.000	642
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	3.041	2.000	0	0	3.041	2.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.043	3.181	0	0	1.043	3.181
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.353	9.752	16.000	16.000	-2.647	-6.248
über 10 Jahre	11.388	9.381	0	0	11.388	9.381

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	28.12.12	28.12.11	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		28.12.12	28.12.11		
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.414	31.192					
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	
	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11
Deutschland	0	0	2.000	2.000	29.414	29.192	0	0

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

	28.12.12	28.12.11	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
			28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11	28.12.12	28.12.11
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	0								
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen										
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