

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)	
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	18.524	19.361	15.911	16.302	20.600	21.184
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.484	31.414	33.116	35.625	28.565	30.164	37.689	39.923
davon gattungsklassische Deckungswerte	28.484	29.414	31.031	33.500	26.543	28.149	35.594	37.780
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.084	2.125	2.022	2.014	2.095	2.143
Überdeckung in %	90,53%	96,34%	78,77%	84,01%	79,53%	85,03%	82,96%	88,46%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,25%					

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	
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
bis einschließlich 1 Jahr	554	0	0	0	554	0
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	3.000	590	0	0	3.000	590
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.927	2.000	0	0	1.927	2.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	960	3.041	0	0	960	3.041
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	131	1.043	1.000	0	-869	1.043
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.347	13.353	15.000	16.000	-1.653	-2.647
über 10 Jahre	10.565	11.388	0	0	10.565	11.388

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	30.12.13		28.12.12		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.12.13		28.12.12	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.484	31.414							
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			
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
Deutschland	0	0	2.000	2.000	28.484	29.414	0	0	0	0

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

	30.12.13		28.12.12							
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0	0							
Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen										
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner			
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
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