

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)	
	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	19.288	18.434	16.342	15.384	21.184	21.768
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.263	36.781	35.184	39.684	29.945	34.121	39.632	46.156
davon gattungsklassische Deckungswerte	29.263	34.781	33.061	37.568	27.921	32.148	37.490	43.966
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.123	2.116	2.024	1.973	2.143	2.190
Überdeckung in %	95,39%	129,88%	82,42%	115,28%	83,24%	121,79%	87,09%	112,04%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,00%					

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	
	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12
bis einschließlich 1 Jahr	393	4.516	0	0	393	4.516
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	197	403	0	0	197	403
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	3.358	222	0	0	3.358	222
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	1.683	3.417	0	0	1.683	3.417
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.033	1.734	0	0	1.033	1.734
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.767	14.745	16.000	16.000	-2.233	-1.255
über 10 Jahre	10.832	11.743	0	0	10.832	11.743

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	28.03.13		28.03.12		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		28.03.13		28.03.12	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.263	36.781							
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			
	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12
Deutschland	0	0	2.000	2.000	29.263	34.781	0	0	0	0

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

	28.03.13		28.03.12		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	0										
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen												
	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12	28.03.13	28.03.12
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