

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)	
	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	18.509	19.027	15.804	15.939	20.624	21.207
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.799	36.195	33.776	40.320	29.028	34.763	38.473	45.163
davon gattungsklassische Deckungswerte	28.799	34.195	31.696	38.203	27.022	32.769	36.378	43.020
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.081	2.117	2.006	1.995	2.095	2.143
Überdeckung in %	92,49%	126,22%	82,48%	111,91%	83,67%	118,11%	86,55%	112,96%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,24%					

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	
	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12
bis einschließlich 1 Jahr	572	4.472	0	0	572	4.472
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	2.000	608	0	0	2.000	608
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.327	2.000	0	0	1.327	2.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.325	1.388	0	0	2.325	1.388
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	461	2.414	0	0	461	2.414
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.454	13.820	16.000	16.000	-2.546	-2.180
über 10 Jahre	10.659	11.493	0	0	10.659	11.493

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	30.09.13		28.09.12		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.09.13		28.09.12	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.799	36.195							
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			
	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12
Deutschland	0	0	2.000	2.000	28.799	34.195	0	0	0	0

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

	30.09.13		28.09.12					
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0	0					
Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen								
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12	30.09.13	28.09.12
Deutschland	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