

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)	
	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	18.445	18.467	15.651	15.392	20.624	21.207
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.951	36.346	34.022	39.766	29.081	34.157	38.865	45.456
davon gattungsklassische Deckungswerte	28.951	34.346	31.946	37.675	27.091	32.199	36.770	43.313
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.076	2.091	1.990	1.958	2.095	2.143
Überdeckung in %	93,44%	127,16%	84,45%	115,34%	85,81%	121,91%	88,45%	114,34%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,26%					

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	
	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12
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	333	2.414	0	0	333	2.414
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.654	13.892	16.000	16.000	-2.346	-2.108
über 10 Jahre	10.738	11.573	0	0	10.738	11.573

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	28.06.13		29.06.12		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		28.06.13		29.06.12	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.951	36.346							
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			
	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12
Deutschland	0	0	2.000	2.000	28.951	34.346	0	0	0	0

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

	28.06.13		29.06.12					
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0	0					
Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen								
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12	28.06.13	29.06.12
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