

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)	
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	18.645	19.288	16.045	16.342	20.225	21.184
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	29.949	31.263	33.221	35.184	28.651	29.945	37.227	39.632
davon gattungsklassische Deckungswerte	27.949	29.263	31.182	33.061	26.663	27.921	35.179	37.490
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.039	2.123	1.989	2.024	2.048	2.143
Überdeckung in %	87,18%	95,39%	78,18%	82,42%	78,57%	83,24%	84,06%	87,09%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,93%					

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	
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
bis einschließlich 1 Jahr	2.171	393	0	0	2.171	393
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	1.297	197	0	0	1.297	197
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.280	3.358	0	0	2.280	3.358
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	300	1.683	0	0	300	1.683
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	124	1.033	1.000	0	-876	1.033
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.292	13.767	15.000	16.000	-1.708	-2.233
über 10 Jahre	10.485	10.832	0	0	10.485	10.832

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	31.03.14		28.03.13		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		31.03.14		28.03.13	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	29.949	31.263							
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			
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
Deutschland	0	0	2.000	2.000	27.949	29.263	0	0	0	0

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

	31.03.14		28.03.13					
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0	0					
Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen								
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
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