

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)	
	31.03.11		31.03.11		31.03.11		31.03.11	
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	10.000		10.113		8.278		12.468	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.659		31.524		27.470		36.820	
davon gattungsklassische Deckungswerte	29.659		29.561		25.681		34.662	
davon sonstige Deckungswerte	2.000		1.962		1.789		2.158	
Überdeckung in %	216,59%		211,71%		231,86%		195,32%	
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			19,40%					

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	
	31.03.11		31.03.11		31.03.11	
bis einschließlich 1 Jahr	1.693		0		1.693	
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	4.601		0		4.601	
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	412		0		412	
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.246		0		2.246	
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.476		0		1.476	
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	11.708		10.000		1.708	
über 10 Jahre	9.523		0		9.523	

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	31.03.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		31.03.11	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.659					
weitere Deckungen						
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto					0,00%	
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut					0,00%	
Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften	
	31.03.11		31.03.11		31.03.11	
Deutschland	0		2.000		29.659	
					31.03.11	
					0	

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

	31.03.11		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
			31.03.11		31.03.11		31.03.11		31.03.11	
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0									
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen										
Deutschland	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