

**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)	
	30.09.11		30.09.11		30.09.11		30.09.11	
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	15.000		16.808		13.850		20.500	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.249		33.069		28.789		38.375	
davon gattungsklassische Deckungswerte	29.249		31.000		26.882		36.185	
davon sonstige Deckungswerte	2.000		2.069		1.907		2.190	
Überdeckung in %	108,33%		96,75%		107,87%		87,19%	
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			12,31%					

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	
	30.09.11		30.09.11		30.09.11	
bis einschließlich 1 Jahr	1.677		0		1.677	
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	4.559		0		4.559	
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	642		0		642	
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.000		0		2.000	
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.447		0		1.447	
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	11.544		15.000		-3.456	
über 10 Jahre	9.381		0		9.381	

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	30.09.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.09.11	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	31.249					
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	
	Sonstige Schuldner					
	30.09.11		30.09.11		30.09.11	
Deutschland	0		2.000		29.249	
					0	

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

	30.09.11	
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen		
	Staat	
	Regionale Gebiets- körperschaften	
	Örtliche Gebiets- körperschaften	
	Sonstige Schuldner	
	30.09.11	
Deutschland	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