

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)	
	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	15.000	18.467	15.549	15.392	12.777	21.207	19.085
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	36.346	31.603	39.766	32.012	34.157	28.013	45.456	37.209
davon gattungsklassische Deckungswerte	34.346	29.603	37.675	30.010	32.199	26.178	43.313	35.024
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.091	2.002	1.958	1.835	2.143	2.185
Überdeckung in %	127,16%	110,68%	115,34%	105,88%	121,91%	119,24%	114,34%	94,96%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,32%					

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	
	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11
bis einschließlich 1 Jahr	4.472	1.693	0	0	4.472	1.693
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	608	4.601	0	0	608	4.601
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.000	658	0	0	2.000	658
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	1.388	2.000	0	0	1.388	2.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.414	1.476	0	0	2.414	1.476
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	13.892	11.651	16.000	15.000	-2.108	-3.349
über 10 Jahre	11.573	9.523	0	0	11.573	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)

	29.06.12		29.06.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		29.06.12		29.06.11	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	36.346	31.603							
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			
	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11
Deutschland	0	0	2.000	2.000	34.346	29.603	0	0	0	0

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

	29.06.12		29.06.11		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	0									
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen												
	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11	29.06.12	29.06.11
Deutschland	0	0	0	0	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