

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 Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten)	
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	10,0	0,0	10,5	0,0	9,2	0,0	11,1	0,0
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	35,0	0,0	39,7	0,0	34,2	0,0	44,4	0,0
davon gattungsklassische Deckungswerte	34,0	0,0	38,6	0,0	33,2	0,0	43,2	0,0
davon sonstige Deckungswerte	1,0	0,0	1,1	0,0	1,0	0,0	1,2	0,0
Überdeckung in %	249,52%	0,00%	279,76%	0,00%	272,77%	0,00%	301,70%	0,00%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,57%					

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 Mio. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
bis einschließlich 1 Jahr	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	0,5	0,0	0,0	0,0	0,5	0,0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2,0	0,0	0,0	0,0	2,0	0,0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	3,0	0,0	0,0	0,0	3,0	0,0
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1,5	0,0	0,0	0,0	1,5	0,0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	9,1	0,0	10,0	0,0	-0,9	0,0
über 10 Jahre	18,9	0,0	0,0	0,0	18,9	0,0

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	28.09.12		28.09.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		28.09.12		28.09.11	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	35,0	0,0							
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			
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Deutschland	0,0	0,0	4,6	0,0	19,3	0,0	11,0	0,0		

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

	28.09.12		28.09.11		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,0	0,0										
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen												
	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11	28.09.12	28.09.11
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	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