

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)	
	30.12.11		30.12.11		30.12.11		30.12.11	
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000		18.182		15.091		21.768	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.950		32.899		28.682		37.879	
davon gattungsklassische Deckungswerte	28.950		30.804		26.740		35.689	
davon sonstige Deckungswerte	2.000		2.095		1.942		2.190	
Überdeckung in %	93,44%		80,94%		90,06%		74,02%	
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,52%					

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	
	30.12.11		30.12.11		30.12.11	
bis einschließlich 1 Jahr	6.184		0		6.184	
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	403		0		403	
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	222		0		222	
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	3.060		0		3.060	
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.092		0		2.092	
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	9.686		16.000		-6.314	
über 10 Jahre	9.303		0		9.303	

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	30.12.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.12.11	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	30.950					
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	
	30.12.11		30.12.11		30.12.11	
Deutschland	0		2.000		28.950	
					Sonstige Schuldner	
					30.12.11	
					0	

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

	30.12.11	
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0	
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	
	30.12.11	
Deutschland	0	
	Regionale Gebiets- körperschaften	
	30.12.11	
	0	
	Örtliche Gebiets- körperschaften	
	30.12.11	
	0	
	Sonstige Schuldner	
	30.12.11	
	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