

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)	
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	25.000	25.000	25.617	26.196	25.225	25.179	25.688	26.375
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	60.731	62.132	67.465	70.027	59.174	61.786	74.882	76.811
davon gattungsklassische Deckungswerte	59.631	61.032	66.311	68.860	58.088	60.714	73.712	75.617
davon sonstige Deckungswerte	1.100	1.100	1.154	1.166	1.086	1.072	1.170	1.194
Überdeckung in %	142,93%	148,53%	163,36%	167,32%	134,58%	145,38%	191,51%	191,23%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			4,51%					

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	
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
bis einschließlich 1 Jahr	0	0	25.000	0	-25.000	0
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	0	0	0	25.000	0	-25.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	30.702	11.945	0	0	30.702	11.945
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	31.338	0	0	0	31.338
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	11.678	0	0	0	11.678	0
über 10 Jahre	18.352	18.850	0	0	18.352	18.850

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	31.03.14		28.03.13		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		31.03.14		28.03.13	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	60.731	62.132							
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			
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
Deutschland	0	0	1.100	1.100	18.352	18.850	41.280	42.182		

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

	31.03.14		28.03.13							
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0	0							
Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen										
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner			
	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13	31.03.14	28.03.13
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

Erläuterungen zu den im Report verwendeten Begriffen

Gattungsklassische Deckungswerte:	- Darlehnsforderungen oder Schuldverschreibungen nach § 20 Abs. 1 PfandBG
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