

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)	
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	25.000	25.000	25.597	26.209	25.048	25.042	25.688	26.375
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	61.738	62.474	67.440	71.237	60.525	62.549	74.003	77.752
davon gattungsklassische Deckungswerte	60.638	61.374	66.291	70.068	59.450	61.480	72.833	76.559
davon sonstige Deckungswerte	1.100	1.100	1.149	1.169	1.074	1.069	1.170	1.194
Überdeckung in %	146,95%	149,90%	163,47%	171,81%	141,63%	149,78%	188,09%	194,80%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			4,49%					

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	
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
bis einschließlich 1 Jahr	0	0	25.000	0	-25.000	0
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	11.927	0	0	25.000	11.927	-25.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	31.332	12.010	0	0	31.332	12.010
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	31.493	0	0	0	31.493
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 10 Jahre	18.478	18.972	0	0	18.478	18.972

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	30.12.13	28.12.12	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.12.13	28.12.12		
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	61.738	62.474					
weitere Deckungen								
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto			0,00%		0,00%			
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut			0,00%			-		
Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen								
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
Deutschland	0	0	1.100	1.100	18.478	18.972	42.160	42.402

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

	30.12.13	28.12.12						
	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	0	0					
Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen								
	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12	30.12.13	28.12.12
Deutschland	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