

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)	
	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	223,0	206,0	258,0	219,1	222,2	186,8	287,9	259,3
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	290,8	271,3	321,0	290,6	295,7	267,7	338,0	316,2
davon gattungsklassische Deckungswerte	265,8	246,3	292,8	264,8	271,3	244,7	307,0	287,1
davon sonstige Deckungswerte	25,0	25,0	28,1	25,8	24,3	23,0	31,0	29,1
Überdeckung in %	30,42%	31,7%	24,39%	32,62%	33,05%	43,27%	17,42%	21,91%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,90%					

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	
	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11
bis einschließlich 1 Jahr	70,0	15,2	10,0	0,0	60,0	15,2
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	31,9	40,4	0,0	10,0	31,9	30,4
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	42,4	40,0	0,0	0,0	42,4	40,0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	22,1	70,9	35,0	0,0	-12,9	70,9
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	26,1	22,5	10,0	35,0	16,1	-12,5
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	97,3	82,2	148,0	106,0	-50,7	-23,8
über 10 Jahre	1,0	0,0	20,0	55,0	-19,0	-55,0

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)						
	29.06.12	30.06.11	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs			
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	290,8	271,3				
			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	
	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11
Deutschland	130,0	100,0	59,8	68,2	72,1	74,2
			Sonstige Schuldner		29,0	29,0

IV) Übersicht über rückständige gattungsklassische Deckungswerte (Angaben in Mio. Euro)				
	29.06.12	30.06.11		
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,0	0,0		
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften	
	29.06.12	30.06.11	29.06.12	30.06.11
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0
			Örtliche Gebiets- körperschaften	
			0,0	0,0
			Sonstige Schuldner	
			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