

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	200.000	195.000	222.150	219.202	197.089	191.576	239.288	238.929
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	315.383	316.550	353.329	361.552	320.709	320.728	368.108	381.538
davon gattungsklassische Deckungswerte	307.383	308.550	345.259	352.478	312.662	312.701	359.997	371.688
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.070	9.073	8.047	8.027	8.111	9.849
Überdeckung in %	57,69%	62,33%	59,05%	64,94%	62,72%	67,42%	53,83%	59,69%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,63%					

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	0	0	0	0
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	30.000	0	0	0	30.000	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	50.000	30.000	0	0	50.000	30.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	205.000	50.000	5.000	0	200.000	50.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.000	208.000	175.000	165.000	-172.000	43.000
über 10 Jahre	27.383	28.550	20.000	30.000	7.383	-1.450

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	315.383	316.550							
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			
	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	285.000	280.000	27.383	28.550	3.000	3.000		
Belgien	0	5.000	0	0	0	0	0	0	0	0

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
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0
Belgien	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