

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)	
	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	176,0	120,0	190,2	128,9	161,8	108,9	225,4	154,0
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	209,1	177,7	228,9	192,9	209,9	174,3	248,6	213,6
davon gattungsklassische Deckungswerte	199,1	167,7	218,1	182,2	200,0	164,7	236,9	201,6
davon sonstige Deckungswerte	10,0	10,0	10,8	10,7	9,9	9,6	11,7	12,0
Überdeckung in %	18,82%	48,06%	20,34%	49,67%	29,73%	60,14%	10,26%	38,72%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,68%					

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	
	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09
bis einschließlich 1 Jahr	14,7	19,4	0,0	0,0	14,7	19,4
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	21,6	10,3	0,0	0,0	21,6	10,3
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	22,2	24,6	10,0	0,0	12,2	24,6
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	36,3	25,5	0,0	10,0	36,3	15,5
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	39,1	12,9	10,0	0,0	29,1	12,9
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	75,4	84,9	111,0	75,0	-35,1	9,9
über 10 Jahre	0,0	0,0	45,0	35,0	-45,0	-35,0

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	31.12.10		31.12.09		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		31.12.10		31.12.09	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	209,1		177,7							
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			
	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09
Deutschland	60,0	65,0	59,3	56,8	60,8	46,9	29,0	9,0		

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

	31.12.10		31.12.09		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,0		0,0									
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner					
	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09	31.12.10	31.12.09
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	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