

## 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)	
	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	223,0	206,0	262,9	231,7	227,2	197,8	286,0	271,0
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	288,8	277,0	322,5	303,8	298,0	278,8	334,7	327,4
davon gattungsklassische Deckungswerte	263,8	252,0	293,9	277,1	273,2	255,0	304,0	297,7
davon sonstige Deckungswerte	25,0	25,0	28,6	26,7	24,8	23,8	30,7	29,7
Überdeckung in %	29,51%	34,45%	22,69%	31,13%	31,17%	40,97%	17,02%	20,78%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,89%					

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	
	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11
bis einschließlich 1 Jahr	68,9	16,0	10,0	0,0	58,9	16,0
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	39,7	40,4	0,0	10,0	39,7	30,4
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	32,7	44,5	0,0	0,0	32,7	44,5
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	27,3	55,0	35,0	0,0	-7,7	55,0
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	20,6	35,3	10,0	35,0	10,6	0,3
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	97,7	85,1	148,0	141,0	-50,3	-55,9
über 10 Jahre	1,9	0,6	20,0	20,0	-18,1	-19,4

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	28.09.12		30.09.11		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		28.09.12		30.09.11	
	Gesamtbetrag der Deckungsmasse	288,8		277,0						
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			
	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11
Deutschland	130,0	115,0	57,8	66,3	72,0	66,7	29,0	29,0		

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

	28.09.12		30.09.11					
	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	
	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11	28.09.12	30.09.11
Deutschland	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