

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)	
	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	146,0	120,0	167,6	129,6	141,5	108,9	197,9	155,7
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	225,6	194,0	252,5	213,2	231,7	193,5	270,7	235,1
davon gattungsklassische Deckungswerte	215,6	184,0	241,2	202,1	221,3	183,6	258,6	222,7
davon sonstige Deckungswerte	10,0	10,0	11,3	11,1	10,4	9,9	12,1	12,4
Überdeckung in %	54,54%	61,69%	50,69%	64,44%	63,68%	77,67%	36,82%	51,00%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,77%					

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	
	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09
bis einschließlich 1 Jahr	24,1	19,4	0,0	0,0	24,1	19,4
über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre	6,8	19,8	0,0	0,0	6,8	19,8
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	30,8	10,6	10,0	0,0	20,8	10,6
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	38,7	14,5	0,0	10,0	38,7	4,5
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	39,7	14,5	0,0	0,0	39,7	14,5
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	85,5	95,8	91,0	65,0	-5,5	30,8
über 10 Jahre	0,0	0,0	45,0	0,0	-45,0	0,0

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

	30.09.10		30.09.09		Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.09.10		30.09.09	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	225,6	194,0								
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			
	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09
Deutschland	75,0	80,0	59,6	57,1	62,1	48,0	29,0	9,0		

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

	30.09.10		30.09.09		Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
					30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,0	0,0										
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen												
	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09	30.09.10	30.09.09
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 |