

Währungsbezeichnung **EUR**
für auf diesem Blatt aufgeführte Beträge



**Report Umlauf Hypothekendarlehen und Deckungsmasse gem. § 28 Abs. 1 Nr. 1 PfandBG
und Report Anteil der Derivate gem. § 28 Abs. 1 Nr. 3 i.V.m. § 19 Abs. 1 Nr. 4 Satz 3 PfandBG**

	Umlauf Pfandbriefe		Deckungsmassen	
	30.09.2012	30.09.2013	30.09.2012	30.09.2013
Nennwert	150.000.000,00	165.000.000,00	206.918.563,49	278.728.693,72
<i>davon Derivategeschäfte</i>			0,00%	0,00%
Barwert	169.970.395,75	179.595.806,19	238.108.367,62	312.824.204,81
Risikobarwert (Stresstest: + 250BP)	146.927.920,58	155.688.521,51	211.511.780,13	281.757.965,51
Risikobarwert (Stresstest: - 250BP)	186.543.636,54	200.938.814,12	254.648.356,75	334.273.061,71