

**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)	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	210.000	200.000	235.566	226.817	211.890	202.050	241.578	235.359
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	313.570	314.787	344.927	353.307	322.311	323.360	348.010	359.716
davon gattungsklassische Deckungswerte	305.570	306.787	336.865	345.227	314.273	315.305	339.935	351.616
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.062	8.079	8.038	8.055	8.076	8.100
Überdeckung in %	49,32%	57,39%	46,42%	55,77%	52,11%	60,04%	44,06%	52,84%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,42%					

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	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	30.000	0	0	0	30.000	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	10.000	0	0	0	10.000	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	240.000	40.000	5.000	0	235.000	40.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	5.000	240.000	50.000	5.000	-45.000	235.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	5.000	100.000	50.000	-100.000	-45.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.000	3.000	55.000	125.000	-52.000	-122.000
über 10 Jahre	25.570	26.787	0	20.000	25.570	6.787

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

**III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)**

Weitere Deckung	Nennwert		Anteil am Pfandbriefumlauf		Überschreitung gesetzlicher Grenzen	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%	0	0
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%		
1. Halbsatz (10,00%)					0	0
2. Halbsatz (2,00%)					0	0

Weitere Deckung nach Ländern und Art der gesetzlichen Begrenzung	§ 20 Abs. 2 Nr. 2 ohne § 4 Abs. 1 Satz 2 Nr. 1 u. 2 PfandBG		davon Forderungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.09.15	30.09.14
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	76,19%	75,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,45%	97,46%

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

## Externer Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

### IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 und 2 PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Tsd. Euro)

Deckungsmasse nach Größenklassen	30.09.15	30.09.14
bis einschließlich 10 Mio.€	28.000	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	285.570	-
mehr als 100 Mio.€	0	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
Deutschland	0	0	285.000	285.000	25.570	26.787	3.000	3.000

	30.09.15	30.09.14
darunter ECA-Finanzierungen	0	-

### V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Tsd. Euro)

Rückständige Leistungen nach Ländern	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14	30.09.15	30.09.14
Deutschland	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. 1, § 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. 1, § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG
Sichernde Überdeckung:	- nach § 4 Abs. 1 PfandBG