

**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)	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	200.000	195.000	227.083	216.403	202.026	190.215	239.206	238.879
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	315.086	316.261	352.828	352.715	321.378	314.337	362.420	375.803
davon gattungsklassische Deckungswerte	307.086	308.261	344.754	343.751	313.347	306.386	354.315	365.958
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.074	8.964	8.031	7.951	8.105	9.846
Überdeckung in %	57,54%	62,19%	55,37%	62,99%	59,08%	65,25%	51,51%	57,32%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,56%					

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	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
bis einschließlich 6 Monate	0	-	0	-	0	-
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	-	0	-	0	-
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	-	0	-	0	-
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	-	0	-	0	-
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	30.000	0	0	0	30.000	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	200.000	30.000	5.000	0	195.000	30.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	55.000	200.000	0	0	55.000	200.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.000	58.000	175.000	165.000	-172.000	-107.000
über 10 Jahre	27.086	28.261	20.000	30.000	7.086	-1.739

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	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0	-	0,00%	-	0	-
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0	0	0,00%	0,00%		
1. Halbsatz (10,00%)					0	-
2. Halbsatz (2,00%)					0	-

Weitere Deckung nach Ländern und Art der gesetzlichen Begrenzung	§ 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG		davon Forderungen im Sinne des Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Deutschland	0	-	0	-
Summe	0	-	0	-

	30.06.14	28.06.13
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	75,00%	-
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,46%	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Deutschland	0	0	285.000	280.000	27.086	28.261	3.000	3.000
Belgien	0	5.000	0	0	0	0	0	0

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

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

IV) Übersicht über rückständige gattungsklassische Deckungswerte (Angaben in Tsd. Euro)							
Rückständige Leistungen nach Ländern	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag				
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13			
Deutschland	0	-	0	-			

Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0
Belgien	0	0	0	0	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
Liquiditätssicherung:	- nach § 4 Abs. 1a PfandBG