

**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)	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	200.000	200.000	226.981	227.083	204.815	202.026	234.160	239.206
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	313.877	315.086	346.142	352.828	321.771	321.378	350.712	362.420
davon gattungsklassische Deckungswerte	305.877	307.086	338.081	344.754	313.753	313.347	342.633	354.315
davon sonstige Deckungswerte	8.000	8.000	8.061	8.074	8.018	8.031	8.079	8.105
Überdeckung in %	56,94%	57,54%	52,50%	55,37%	57,10%	59,08%	49,77%	51,51%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,55%					

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	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
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.	0	0	0	0	0	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	30.000	0	0	0	30.000	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	200.000	30.000	5.000	0	195.000	30.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	55.000	200.000	0	5.000	55.000	195.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	55.000	50.000	0	-50.000	55.000
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	3.000	3.000	125.000	175.000	-122.000	-172.000
über 10 Jahre	25.877	27.086	20.000	20.000	5.877	7.086

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	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
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	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.06.15	30.06.14
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	75,00%	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	30.06.15	30.06.14
bis einschließlich 10 Mio.€	28.000	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	285.877	-
mehr als 100 Mio.€	0	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0	0	285.000	285.000	25.877	27.086	3.000	3.000

	30.06.15	30.06.14
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	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
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	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
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