

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) | |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
| | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | 25.000 | 25.000 | 26.258 | 26.820 | 25.554 | 25.505 | 26.375 | 27.063 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 61.439 | 62.813 | 67.685 | 71.465 | 60.397 | 62.547 | 74.552 | 78.717 |
| davon gattungsklassische Deckungswerte | 60.339 | 61.713 | 66.517 | 70.282 | 59.310 | 61.470 | 73.359 | 77.501 |
| davon sonstige Deckungswerte | 1.100 | 1.100 | 1.168 | 1.183 | 1.087 | 1.077 | 1.194 | 1.216 |
| Überdeckung in % | 145,75% | 151,25% | 157,77% | 166,46% | 136,35% | 145,23% | 182,66% | 190,87% |
| Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in % | | | 4,45% | | | | | |

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 | |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
| | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 |
| bis einschließlich 1 Jahr | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 1 Jahr bis einschließlich 2 Jahre | 11.813 | 0 | 25.000 | 0 | -13.187 | 0 |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre | 29.923 | 12.074 | 0 | 25.000 | 29.923 | -12.926 |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre | 1.100 | 7.492 | 0 | 0 | 1.100 | 7.492 |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre | 0 | 24.154 | 0 | 0 | 0 | 24.154 |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| über 10 Jahre | 18.603 | 19.092 | 0 | 0 | 18.603 | 19.092 |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

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

| | 30.09.13 | | 28.09.12 | | Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs | | 30.09.13 | | 28.09.12 | |
|---|--------------------------------|----------|--------------------------------------|----------|---|----------|-----------------------|----------|----------|----------|
| | Gesamtbetrag der Deckungsmasse | 61.439 | 62.813 | | | | | | | |
| 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 | | | |
| | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 |
| Deutschland | 0 | 0 | 1.100 | 1.100 | 18.603 | 19.092 | 41.736 | 42.620 | | |

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

| | 30.09.13 | | 28.09.12 | | | | | | | |
|--|---|----------|--------------------------------------|----------|-------------------------------------|----------|-----------------------|----------|----------|----------|
| | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen | 0 | 0 | | | | | | | |
| Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | | | | | | | | | | |
| | Staat | | Regionale Gebiets- körperschaften | | Örtliche Gebiets- körperschaften | | Sonstige Schuldner | | | |
| | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 | 30.09.13 | 28.09.12 |
| Deutschland | 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 |