

**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	0	25.000	0	25.667	0	25.431	0	25.688
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	40.099	78.597	42.895	90.033	35.821	76.973	46.491	100.817
davon gattungsklassische Deckungswerte	40.099	77.497	42.895	88.872	35.821	75.874	46.491	99.647
davon sonstige Deckungswerte	0	1.100	0	1.162	0	1.100	0	1.170
Überdeckung in %	0,00%	214,39%	0,00%	250,78%	0,00%	202,68%	0,00%	292,47%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			0,00%					

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	25.000	0	-25.000
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	0	7.208	0	0	0	7.208
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	0	23.331	0	0	0	23.331
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	11.330	11.610	0	0	11.330	11.610
über 10 Jahre	28.770	36.448	0	0	28.770	36.448

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	0,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	100,00%

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.€	0	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	40.099	-
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	0	1.100	0	36.448	40.099	41.048

	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