

## 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)	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	19.327	18.509	16.783	15.804	20.040	20.624
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	29.327	30.799	33.689	33.776	29.108	29.028	36.182	38.473
davon gattungsklassische Deckungswerte	27.327	28.799	31.643	31.696	27.087	27.022	34.134	36.378
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.046	2.081	2.021	2.006	2.048	2.095
Überdeckung in %	83,29%	92,49%	74,31%	82,48%	73,43%	83,67%	80,55%	86,55%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,59%					

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	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
bis einschließlich 6 Monate	2.000	-	0	-	2.000	-
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0	-	0	-	0	-
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	1.266	-	0	-	1.266	-
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	-	0	-	0	-
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.233	1.327	0	0	2.233	1.327
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	386	2.325	0	0	386	2.325
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.372	461	1.000	0	1.372	461
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	10.758	13.454	15.000	16.000	-4.242	-2.546
über 10 Jahre	10.311	10.659	0	0	10.311	10.659

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	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
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	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
Deutschland	0	-	0	-
Summe	0	-	0	-

	30.09.14	30.09.13
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	-
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
Deutschland	0	0	2.000	2.000	27.327	28.799	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	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
Deutschland	0	-	0	-

Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13	30.09.14	30.09.13
Deutschland	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