



**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	16.000	16.000	18.972	18.445	16.384	15.651	20.040	20.624
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	29.479	30.951	33.298	34.022	28.702	29.081	36.466	38.865
davon gattungsklassische Deckungswerte	27.479	28.951	31.255	31.946	26.697	27.091	34.418	36.770
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.042	2.076	2.005	1.990	2.048	2.095
Überdeckung in %	84,24%	93,44%	75,51%	84,45%	75,18%	85,81%	81,97%	88,45%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			10,76%					

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	0	-
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	2.000	572	0	0	2.000	572
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	985	-	0	0	985	-
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	281	2000	0	0	281	2000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.233	1327	0	0	2.233	1327
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	287	2325	0	0	287	2325
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	2.489	333	1.000	0	1.489	333
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	10.813	13654	15.000	16.000	-4.187	-2346
über 10 Jahre	10.391	10738	0	0	10.391	10738

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	0,00%	0%	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 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	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.06.14	28.06.13
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100%	100%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100%	100%

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	2.000	2.000	27.479	28.951	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	28.06.14			
Deutschland	0	0	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

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 - sichere 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
Sichere Überdeckung:	- nach § 4 Abs. 1 PfandBG
Liquiditätssicherung:	- nach § 4 Abs. 1a PfandBG