

**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 Mio. Euro)

|   | Nennwert |          | Barwert  |          | Risikobarwert *)<br>(Verschieb. n. oben) |          | Risikobarwert *)<br>(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                    | 228,0    | 228,0    | 262,7    | 265,4    | 236,6                                    | 234,4    | 270,2                                     | 278,6    |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse                        | 263,6    | 286,9    | 286,5    | 312,4    | 264,2                                    | 288,6    | 293,1                                     | 321,6    |
| davon gattungsklassische<br>Deckungswerte             | 220,6    | 251,9    | 239,7    | 273,4    | 220,1                                    | 253,0    | 245,9                                     | 281,7    |
| davon sonstige Deckungswerte                          | 43,0     | 35,0     | 46,8     | 39,0     | 44,1                                     | 35,6     | 47,2                                      | 39,9     |
| Überdeckung in %                                      | 15,63%   | 25,85%   | 9,04%    | 17,70%   | 11,66%                                   | 23,12%   | 8,48%                                     | 15,42%   |
| Sichernde Überdeckung gem.<br>§ 4 Abs. 1 PfandBG in % |          |          | 14,59%   |          |  |          |   |          |

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 Mio. 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              | 7,8           | 14,2     | 10,0             | 0,0      | -2,2     | 14,2     |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.   | 26,9          | 34,8     | 25,0             | 0,0      | 1,9      | 34,8     |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.  | 18,3          | 8,1      | 10,0             | 10,0     | 8,3      | -1,9     |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre  | 11,4          | 30,0     | 0,0              | 25,0     | 11,4     | 5,0      |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre  | 28,5          | 30,6     | 30,0             | 10,0     | -1,5     | 20,6     |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre  | 21,7          | 28,6     | 0,0              | 30,0     | 21,7     | -1,4     |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre  | 32,5          | 21,8     | 33,0             | 0,0      | -0,5     | 21,8     |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 99,5          | 111,3    | 120,0            | 143,0    | -20,5    | -31,7    |
| über 10 Jahre                            | 17,0          | 7,4      | 0,0              | 10,0     | 17,0     | -2,6     |

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

**III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse** (Angaben in Mio. Euro)

| Weitere Deckung                | Nennwert |          | Anteil am<br>Pfandbriefumlauf |          | Überschreitung<br>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      | 0,0      | 0,00%                         | 0,00%    | 0,0                                    | 0,0      |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG | 8,0      | 0,0      | 3,51%                         | 0,00%    |  |          |
| 1. Halbsatz (10,00%)           |          |          |                               |          | 0,0                                    | 0,0      |
| 2. Halbsatz (2,00%)            |          |          |                               |          | 0,0                                    | 0,0      |

  

| Weitere Deckung nach Ländern und<br>Art der gesetzlichen Begrenzung | § 20 Abs. 2 Nr. 2<br>ohne § 4 Abs. 1<br>Satz 2 Nr. 1 u. 2<br>PfandBG | § 20 Abs. 2 Nr. 2<br>PfandBG | davon Forderungen<br>im Sinne des Art. 129<br>Verordnung (EU)<br>Nr. 575/2013 |          |
|---|--|------------------------------|---|----------|
|   | 30.06.15   | 30.06.14                     | 30.06.15  | 30.06.14 |
| Deutschland   | 8,0  | 0,0                          | 0,0   | 0,0      |
| Summe   | 8,0  | 0,0                          | 0,0   | 0,0      |

  

|  | 30.06.15 | 30.06.14 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher<br>Pfandbriefe   | 100,00%  | 100,00%  |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher<br>Deckungswerte | 73,74%   | 82,74%   |

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 Mio. Euro) |          |          |                                 |          |                                |          |                    |          |
|--|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| Deckungsmasse nach Größenklassen   | 30.06.15 | 30.06.14 |                                 |          |                                |          |                    |          |
| bis einschließlich 10 Mio.€  | 93,6     | -        |                                 |          |                                |          |                    |          |
| mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€   | 170,0    | -        |                                 |          |                                |          |                    |          |
| mehr als 100 Mio.€   | 0,0      | -        |                                 |          |                                |          |                    |          |
| 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      | 0,0      | 110,4                           | 122,1    | 96,3                           | 95,8     | 57,0               | 69,0     |
|  | 30.06.15 | 30.06.14 |                                 |          |                                |          |                    |          |
| darunter ECA-Finanzierungen  | 0,0      | -        |                                 |          |                                |          |                    |          |

| V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Mio. Euro) |  |          |  |          |                                |          |                    |          |
|---|--|----------|--|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
| Rückständige Leistungen nach Ländern  | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen |          | Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag |          |                                |          |                    |          |
|   | 30.06.15   | 30.06.14 | 30.06.15                                       | 30.06.14 |                                |          |                    |          |
| Deutschland   | 0,0  | 0,0      | 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      | 0,0                            | 0,0      | 0,0                | 0,0      |
| Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag 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      | 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<br>- sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG<br>- 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   |