

**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) |          |
|---|----------|----------|----------|----------|--|----------|---|----------|
|   | 31.03.15 | 31.03.14 | 31.03.15 | 31.03.14 | 31.03.15                                 | 31.03.14 | 31.03.15                                  | 31.03.14 |
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs                    | 30,0     | 30,0     | 33,8     | 31,1     | 28,2                                     | 25,5     | 34,9                                      | 35,5     |
| Gesamtbetrag der Deckungsmasse                        | 45,2     | 46,8     | 52,1     | 50,3     | 44,8                                     | 43,3     | 54,1                                      | 57,0     |
| davon gattungsklassische<br>Deckungswerte             | 40,2     | 41,8     | 46,8     | 45,0     | 39,8                                     | 38,4     | 48,8                                      | 51,6     |
| davon sonstige Deckungswerte                          | 5,0      | 5,0      | 5,3      | 5,3      | 5,0                                      | 4,9      | 5,3                                       | 5,4      |
| Überdeckung in %                                      | 50,74%   | 55,93%   | 54,02%   | 62,08%   | 58,83%                                   | 69,96%   | 54,73%                                    | 60,35%   |
| Sichernde Überdeckung gem.<br>§ 4 Abs. 1 PfandBG in % |          |          | 15,60%   |          |  |          |   |          |

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 |          |
|--|---------------|----------|------------------|----------|----------|----------|
|  | 31.03.15      | 31.03.14 | 31.03.15         | 31.03.14 | 31.03.15 | 31.03.14 |
| bis einschließlich 6 Monate              | 0,0           | -        | 0,0              | -        | 0,0      | -        |
| über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.   | 3,2           | -        | 0,0              | -        | 3,2      | -        |
| über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.  | 0,0           | -        | 0,0              | -        | 0,0      | -        |
| über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre  | 7,9           | -        | 0,0              | -        | 7,9      | -        |
| über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre  | 3,1           | 8,0      | 0,0              | 0,0      | 3,1      | 8,0      |
| über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre  | 3,7           | 3,2      | 0,0              | 0,0      | 3,7      | 3,2      |
| über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre  | 1,5           | 3,7      | 0,0              | 0,0      | 1,5      | 3,7      |
| über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre | 0,0           | 1,6      | 30,0             | 30,0     | -30,0    | -28,4    |
| über 10 Jahre                            | 25,8          | 26,9     | 0,0              | 0,0      | 25,8     | 26,9     |

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 |          |
|--------------------------------|----------|----------|-------------------------------|----------|--|----------|
|                                | 31.03.15 | 31.03.14 | 31.03.15                      | 31.03.14 | 31.03.15                               | 31.03.14 |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG | 0,0      | -        | 0,00%                         | -        | 0,0                                    | -        |
| nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG | 0,0      | 0,0      | 0,00%                         | 0,00%    |  |          |
| 1. Halbsatz (10,00%)           |          |          |                               |          | 0,0                                    | -        |
| 2. Halbsatz (2,00%)            |          |          |                               |          | 0,0                                    | -        |

| Weitere Deckung nach Ländern und<br>Art der gesetzlichen Begrenzung | § 20 Abs. 2 Nr. 2<br>PfandBG |          | davon Forderungen<br>im Sinne des Art. 129<br>Verordnung (EU)<br>Nr. 575/2013 |          |
|---|------------------------------|----------|---|----------|
|   | 31.03.15                     | 31.03.14 | 31.03.15  | 31.03.14 |
| Deutschland   | 0,0                          | -        | 0,0   | -        |
| Summe   | 0,0                          | -        | 0,0   | -        |

|  | 31.03.15 | 31.03.14 |
|--|----------|----------|
| Prozentualer Anteil festverzinslicher<br>Pfandbriefe   | 100,00%  | -        |
| Prozentualer Anteil festverzinslicher<br>Deckungswerte | 100,00%  | -        |

| Deckungsmasse nach Ländern und<br>Schuldnerklassen | Staat    |          | Regionale Gebiets-<br>körperschaften |          | Örtliche Gebiets-<br>körperschaften |          | Sonstige<br>Schuldner |          |
|--|----------|----------|--------------------------------------|----------|-------------------------------------|----------|-----------------------|----------|
|  | 31.03.15 | 31.03.14 | 31.03.15                             | 31.03.14 | 31.03.15                            | 31.03.14 | 31.03.15              | 31.03.14 |
| Deutschland  | 0,0      | 0,0      | 14,3                                 | 14,8     | 20,7                                | 21,7     | 10,2                  | 10,3     |

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 Mio. Euro)

| Rückständige Leistungen nach Ländern | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen |          | Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag |          |
|--------------------------------------|--|----------|---|----------|
|                                      | 31.03.15   | 31.03.14 | 31.03.15  | 31.03.14 |
| Deutschland                          | 0,0  | -        | 0,0   | -        |

| Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen | Staat    |          | Regionale Gebietskörperschaften |          | Örtliche Gebietskörperschaften |          | Sonstige Schuldner |          |
|---|----------|----------|---------------------------------|----------|--------------------------------|----------|--------------------|----------|
|   | 31.03.15 | 31.03.14 | 31.03.15                        | 31.03.14 | 31.03.15                       | 31.03.14 | 31.03.15           | 31.03.14 |
| 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   |
| Liquiditätssicherung:             | - nach § 4 Abs. 1a PfandBG  |