



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	35.000	35.000	38.141	36.643	29.598	27.982	43.733	44.464
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	74.086	62.322	81.928	69.215	71.863	60.392	85.428	73.341
davon gattungsklassische Deckungswerte	69.086	57.322	76.906	64.181	66.849	55.366	80.406	68.303
davon sonstige Deckungswerte	5.000	5.000	5.022	5.035	5.014	5.027	5.022	5.039
Überdeckung in %	111,67%	78,06%	114,80%	88,89%	142,80%	115,83%	95,34%	64,94%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			13,17%					

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	0	0	0
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	5.000	0	0	0	5.000	0
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	0	5.000	0	0	0	5.000
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	1.582	0	0	0	1.582	0
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	519	1.670	0	0	519	1.670
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	65.688	55.652	0	0	65.688	55.652
über 10 Jahre	1.298	0	35.000	35.000	-33.702	-35.000

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
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.06.15	30.06.14
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	93,25%	91,98%

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.€	33.246	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	40.840	-
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	18.000	18.591	51.086	38.731	0	0
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	5.000	5.000

	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
Europäische Investitionsbank	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	-
Europäische Investitionsbank	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