



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)	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	73.000	35.000	80.658	38.141	65.274	29.598	82.865	43.733
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	78.097	74.086	88.017	81.928	78.084	71.863	88.138	85.428
davon gattungsklassische Deckungswerte	73.097	69.086	83.009	76.906	73.085	66.849	83.131	80.406
davon sonstige Deckungswerte	5.000	5.000	5.008	5.022	4.999	5.014	5.006	5.022
Überdeckung in %	6,98%	111,67%	9,12%	114,80%	19,62%	142,80%	6,36%	95,34%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,21%					

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	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
bis einschließlich 6 Monate	0	0	0	0	0	0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	5.000	0	0	0	5.000	0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0	0	0	0	0	0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	5.000	0	0	0	5.000
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	1.490	0	0	0	1.490	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	410	1.582	0	0	410	1.582
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	21.620	519	0	0	21.620	519
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	46.421	65.688	63.000	0	-16.579	65.688
über 10 Jahre	3.157	1.298	10.000	35.000	-6.843	-33.702

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	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
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	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.06.16	30.06.15
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	93,60%	93,25%

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	30.06.16	30.06.15
bis einschließlich 10 Mio.€	25.223	33.246
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	52.874	40.840
mehr als 100 Mio.€	0	0

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
Deutschland	0	0	17.405	18.000	55.692	51.086	0	0
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	5.000	5.000

	30.06.16	30.06.15
darunter ECA-Finanzierungen	0	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% Rückstandsbetrag	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	0	0

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15	30.06.16	30.06.15
Deutschland	0	0	0	0	0	0	0	0
Europäische Investitionsbank	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