



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)	
	30.09.14		30.09.14		30.09.14		30.09.14	
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	35.000		38.164		29.263		44.464	
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	61.770		69.343		60.642		72.209	
davon gattungsklassische Deckungswerte	56.770		64.311		55.617		67.175	
davon sonstige Deckungswerte	5.000		5.032		5.024		5.034	
Überdeckung in %	76,49%		81,70%		107,23%		62,40%	
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			13,19%					

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	
	30.09.14		30.09.14		30.09.14	
bis einschließlich 6 Monate	0		0		0	
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	0		0		0	
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	0		0		0	
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0		0		0	
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	5.000		0		5.000	
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0		0		0	
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.648		0		1.648	
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	55.122		0		55.122	
über 10 Jahre	0		35.000		-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	
	30.09.14		30.09.14		30.09.14	
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0		0,00%		0	
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0		0,00%			
1. Halbsatz (10,00%)					0	
2. Halbsatz (2,00%)					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	
	30.09.14		30.09.14	
Europäische Investitionsbank	0		0	
Summe	0		0	

	30.09.14	
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	91,91%	

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.14		30.09.14		30.09.14		30.09.14	
Deutschland	0		18.461		38.309		0	
Europäische Investitionsbank	0		0		0		5.000	

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	
	30.09.14		30.09.14	
Deutschland	0		0	

Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.09.14		30.09.14		30.09.14		30.09.14	
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
Liquiditätssicherung:	- nach § 4 Abs. 1a PfandBG