



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)	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	35.000	0	39.959	0	30.746	0	44.464	0
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	65.970	5.000	74.841	5.030	65.475	5.022	77.093	5.043
davon gattungsklassische Deckungswerte	60.970	0	69.812	0	60.454	0	72.064	0
davon sonstige Deckungswerte	5.000	5.000	5.029	5.030	5.021	5.022	5.029	5.043
Überdeckung in %	88,48%	0,00%	87,30%	0,00%	112,95%	0,00%	73,38%	0,00%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			12,58%					

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	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
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	0	0	5.000	0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	5.000	0	0	0	5.000
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1.626	0	0	0	1.626	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	59.343	0	0	0	59.343	0
über 10 Jahre	0	0	35.000	0	-35.000	0

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	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0	-	0,00%	-	0	-
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0	0	0,00%	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	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
Europäische Investitionsbank	0	-	0	-
Summe	0	-	0	-

	30.12.14	30.12.13
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	-
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	92,42%	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
Deutschland	0	-	18.332	-	42.638	-	0	-
Europäische Investitionsbank	0	0	0	0	0	0	5.000	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% Rückstandsbetrag	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
Deutschland	0	-	0	-

Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13	30.12.14	30.12.13
Deutschland	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
Liquiditätssicherung:	- nach § 4 Abs. 1a PfandBG