

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	16.000	16.000	18.975	18.869	17.046	16.617	18.872	19.456
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	27.609	28.567	32.547	32.638	28.215	28.156	33.122	34.912
davon gattungsklassische Deckungswerte	25.609	26.567	30.284	30.461	26.256	26.309	30.859	32.612
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.263	2.177	1.959	1.847	2.263	2.300
Überdeckung in %	72,56%	78,55%	71,53%	72,97%	65,52%	69,44%	75,51%	79,44%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,93%					

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	1.487	955	0	0	1.487	955
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	548	248	0	0	548	248
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	187	1.546	0	0	187	1.546
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0	590	0	0	0	590
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	2.296	238	1.000	0	1.296	238
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	2.394	0	1.000	0	1.394
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	9.903	0	15.000	0	-5.097	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	5.963	15.051	0	15.000	5.963	51
über 10 Jahre	7.227	7.545	0	0	7.227	7.545

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
Deutschland	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	100,00%	100,00%

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.€	15.131	15.726
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	12.478	12.841
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	2.000	2.000	25.609	26.567	0	0

	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% Rückstandsbeitrag	
	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

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag 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

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