

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)	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	16.000	16.000	19.124	19.519	17.040	17.045	19.432	20.016
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	28.107	29.025	32.194	33.729	27.962	29.134	33.978	35.560
davon gattungsklassische Deckungswerte	26.107	27.025	30.010	31.682	26.093	27.099	31.715	33.513
davon sonstige Deckungswerte	2.000	2.000	2.184	2.047	1.869	2.035	2.263	2.048
Überdeckung in %	75,67%	81,40%	68,35%	72,80%	64,10%	70,93%	74,85%	77,66%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			11,42%					

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	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
bis einschließlich 6 Monate	1.172	2.000	0	0	1.172	2.000
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	1.517	970	0	0	1.517	970
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	569	265	0	0	569	265
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	213	1.574	0	0	213	1.574
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	76	873	1.000	0	-924	873
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	2.269	104	0	1.000	2.269	-897
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	5.366	2.338	0	0	5.366	2.338
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	9.540	10.683	15.000	15.000	-5.460	-4.317
über 10 Jahre	7.386	10.217	0	0	7.386	10.217

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	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
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	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
Deutschland	0	0	0	0
Summe	0	0	0	0

	30.12.15	30.12.14
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	30.12.15	30.12.14
bis einschließlich 10 Mio.€	15.447	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	12.660	-
mehr als 100 Mio.€	0	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
Deutschland	0	0	2.000	2.000	26.107	27.025	0	0

	30.12.15	30.12.14
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	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
Deutschland	0	0	0	0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
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	
	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14	30.12.15	30.12.14
Deutschland	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