Sparkasse Mittelthüringen

Stichtag	30.06.2015
Referenz	30.06.2014

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 Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. n. oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. n. unten)	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	30,0	30,0	32,8	32,2	27,6	26,6	34,9	35,5
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	45,8	46,5	50,7	51,2	44,2	44,1	54,6	56,5
davon gattungsklassische Deckungswerte	40,8	41,5	45,4	45,8	39,1	39,1	49,3	51,1
davon sonstige Deckungswerte	5,0	5,0	5,3	5,3	5,1	5,0	5,3	5,4
Überdeckung in %	52,83%	55,03%	54,67%	58,84%	60,22%	65,96%	56,29%	59,06%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			16,10%					

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 Mio. Euro)

	Deckungsmasse		Pfandbriefumlauf		Überhang	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
bis einschließlich 6 Monate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
über 6 Mon. bis einschließlich 12 Mon.	3,2	0,0	0,0	0,0	3,2	0,0
über 12 Mon. bis einschließlich 18 Mon.	7,9	0,0	0,0	0,0	7,9	0,0
über 18 Mon. bis einschließlich 2 Jahre	0,0	3,4	0,0	0,0	0,0	3,4
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	3,1	8,0	0,0	0,0	3,1	8,0
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	3,6	3,2	0,0	0,0	3,6	3,2
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	1,5	3,7	0,0	0,0	1,5	3,7
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	0,0	1,6	30,0	30,0	-30,0	-28,4
über 10 Jahre	26,4	26,7	0,0	0,0	26,4	26,7

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. PfandBG zur Zusammensetzung der Deckungsmasse (Angaben in Mio. Euro)

Weitere Deckung	Nennwert		Anteil am Pfandbriefumlauf		Überschreitung gesetzlicher Grenzen	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
nach § 20 Abs. 2 Nr. 1 PfandBG	0,0	0,0	0,00%	0,00%	0,0	0,0
nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG	0,0	0,0	0,00%	0,00%		
1. Halbsatz (10,00%)					0,0	0,0
2. Halbsatz (2,00%)					0,0	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	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe	0,0	0,0	0,0	0,0

	30.06.15	30.06.14
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	100,00%

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

Sparkasse Mittelthüringen

Stichtag	30.06.2015
Referenz	30.06.2014

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 Mio. Euro)

Deckungsmasse nach Größenklassen	30.06.15	30.06.14
bis einschließlich 10 Mio.€	45,8	-
mehr als 10 Mio.€ bis einschließlich 100 Mio.€	0,0	-
mehr als 100 Mio.€	0,0	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0,0	0,0	15,1	14,7	20,6	21,5	10,1	10,3

	30.06.15	30.06.14
darunter ECA-Finanzierungen	0,0	-

V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG über rückständige Forderungen (Angaben in Mio. Euro)

Rückständige Leistungen nach Ländern	Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14	30.06.15	30.06.14
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