

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)	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	25.000	25.000	25.667	26.218	25.431	25.356	25.688	26.375
Gesamtbetrag der Deckungsmasse	78.597	61.787	90.033	68.538	76.973	60.838	100.817	75.733
davon gattungsklassische Deckungswerte	77.497	60.687	88.872	67.375	75.874	59.762	99.647	74.539
davon sonstige Deckungswerte	1.100	1.100	1.162	1.163	1.100	1.076	1.170	1.194
Überdeckung in %	214,39%	147,15%	250,78%	161,41%	202,68%	139,93%	292,47%	187,14%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			4,53%					

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	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
bis einschließlich 6 Monate	0	-	25.000	-	-25.000	-
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	7.208	-	0	-	7.208	-
über 2 Jahre bis einschließlich 3 Jahre	23.331	19.251	0	0	23.331	19.251
über 3 Jahre bis einschließlich 4 Jahre	0	23.809	0	0	0	23.809
über 4 Jahre bis einschließlich 5 Jahre	0	0	0	0	0	0
über 5 Jahre bis einschließlich 10 Jahre	11.610	0	0	0	11.610	0
über 10 Jahre	36.448	18.727	0	0	36.448	18.727

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	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
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	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Deutschland	0	-	0	-
Summe	0	-	0	-

	30.06.14	28.06.13
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	-
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	100,00%	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebiets- körperschaften		Örtliche Gebiets- körperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
Deutschland	0	0	1.100	1.100	36.448	18.727	41.048	41.960

Keine Deckungswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen im Pfandbriefportfolio.

S Stadtparkasse Wuppertal

Stichtag	30.06.2014
Referenz	28.06.2013

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					
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13				
Deutschland	0	-	0	-				

Rückständige Leistungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner	
	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13	30.06.14	28.06.13
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
Liquiditätssicherung:	- nach § 4 Abs. 1a PfandBG