

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	II 2014
Referenz	II 2013

I) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zum Gesamtbetrag

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert * (Verschieb. nach unten)	
	II 2014	II 2013	II 2014	II 2013	II 2014	II 2013	II 2014	II 2013
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	70,00	25,00	74,17	25,81	64,91	22,76	78,78	27,53
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	342,70	299,62	368,46	324,40	338,85	297,09	380,11	342,46
davon gattungsklassische Deckungswerte	340,45	297,37	366,19	322,12	336,59	294,82	377,84	340,19
davon sonstige Deckungswerte	2,25	2,25	2,27	2,28	2,26	2,27	2,27	2,27
Überdeckung in %	389,58%	1098,49%	396,81%	1156,96%	422,04%	1205,46%	382,50%	1143,78%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			3,06%					

II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur II 2014		Laufzeitstruktur II 2013		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	II 2014	II 2013
bis zu sechs Monate	82,20	0,00			82,20	
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	14,38	0,00	22,70	0,00	14,38	22,70
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	6,61	0,00			6,61	
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,56	0,00	21,29	0,00	20,56	21,29
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	24,72	5,00	28,98	0,00	19,72	28,98
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	13,79	15,00	26,53	0,00	-1,21	26,53
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	20,65	20,00	19,35	15,00	0,65	4,35
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	136,35	30,00	130,48	10,00	106,35	120,48
über 10 Jahre	23,46	0,00	50,30	0,00	23,46	50,30

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

* Nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)

(Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Deckung nach	II 2014				II 2013			
	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf
§20 PfandBG Abs. 2 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-
§20 PfandBG Abs. 2 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach Art der gesetzl. Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	II 2014	II 2013	II 2014	II 2013
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	II 2014	II 2013	II 2014	II 2013	II 2014	II 2013
keine	-	-	-	-	-	-

	II 2014	II 2013
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	68,01%	**
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	85,71%	**

** Neue gesetzlich geforderte Kennzahlen, für die keine Vorjahresdaten ermittelt werden können.

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	II 2014
Referenz	II 2013

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2014	II 2013
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	342,70	299,62

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	II 2014	II 2013
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	II 2014				II 2013			
	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
Bundesrepublik Deutschland	-	29,89	147,91	164,90	-	29,89	89,68	180,05

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 3 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2014	II 2013
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	-	-

Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe	Quartal
	-	-	-	-	-	II 2014
	-	-	-	-	-	II 2013

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe	Quartal
	-	-	-	-	-	II 2014
	-	-	-	-	-	II 2013