

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	III 2014
Referenz	III 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)	
	III 2014	III 2013	III 2014	III 2013	III 2014	III 2013	III 2014	III 2013
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	70,00	35,00	75,24	36,09	66,18	31,13	78,56	39,69
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	351,41	326,97	381,44	348,22	351,00	320,46	390,24	366,70
davon gattungsklassische Deckungswerte	349,16	324,72	379,17	345,94	348,74	318,19	387,97	364,43
davon sonstige Deckungswerte	2,25	2,25	2,26	2,28	2,26	2,27	2,26	2,27
Überdeckung in %	402,02%	834,21%	406,94%	864,96%	430,37%	929,45%	396,72%	823,82%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			3,01%	6,31%				

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2014		Laufzeitstruktur III 2013		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2014	III 2013
bis zu sechs Monate	81,40	-	90,48	-	81,40	90,48
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	14,71	-	-	-	14,71	-
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	6,94	-	19,21	-	6,94	19,21
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	21,64	-	-	-	21,64	-
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	24,13	5,00	27,66	-	19,13	27,66
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	24,33	15,00	23,24	-	9,33	23,24
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	31,98	20,00	22,90	15,00	11,98	7,90
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	119,56	30,00	119,34	20,00	89,56	99,34
über 10 Jahre	26,71	-	24,14	-	26,71	24,14

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	III 2014				III 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	
	III 2014	III 2013	III 2014	III 2013
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

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

	III 2014	III 2013
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	69,03%	**
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	III 2014
Referenz	III 2013

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2014	III 2013
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	351,41	326,97

Anteil am Pfandbriefumlauf	III 2014	III 2013
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Quartal	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
Bundesrepublik Deutschland	III 2014	-	29,89	156,98	164,54
	III 2013	-	29,89	120,64	176,44

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

(Angaben in Mio. Euro)

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

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

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