

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag	IV 2014
Referenz	IV 2013

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert * (Verschiebung nach oben)		Risikobarwert * (Verschiebung nach unten)	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	120,00	50,00	126,43	50,78	113,20	44,56	129,19	54,96
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	355,02	342,22	387,35	364,17	357,15	335,05	393,83	384,27
davon gattungsklassische Deckungswerte	351,02	339,97	383,32	361,89	353,20	332,78	389,80	382,00
davon sonstige Deckungswerte	4,00	2,25	4,03	2,28	3,94	2,27	4,03	2,27
Überdeckung in %	195,85%	584,43%	206,37%	617,19%	215,49%	651,92%	204,84%	599,17%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)			3,18%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2014		Laufzeitstruktur IV 2013		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2014	IV 2013
bis zu sechs Monate	89,29	-	94,42	-	89,29	94,42
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	6,36	-			6,36	
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	20,32	-	20,71	-	20,32	20,71
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	9,66	5,00			4,66	
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	24,38	-	30,12	5,00	24,38	25,12
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	18,52	75,00	16,27	-	56,48	16,27
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	29,80	10,00	24,47	25,00	19,80	0,53
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	126,61	30,00	132,19	20,00	96,61	112,19
über 10 Jahre	30,06	-	24,04	-	30,06	24,04

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

* Nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertIV

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

(Angaben in Mio. Euro)

Deckung nach	IV 2014				IV 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)	
	IV 2014	IV 2013	IV 2014	IV 2013
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

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

	IV 2014	IV 2013
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	69,19%	**
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	91,67%	**

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

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

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	IV 2014	IV 2013
	355,02	342,22

Weitere Deckungswerte (Anteil am Pfandbriefumlauf)	IV 2014	IV 2013
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	IV 2014	-	31,25	158,59	164,17
Spanien	IV 2014	1,00	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	IV 2013	-	29,89	135,77	176,56
Spanien	IV 2013	-	-	-	-

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

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2014	IV 2013
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	-	-

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

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