

# Sparkasse Holstein

## Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	I 2014
Referenz	I 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)	
	I 2014	I 2013	I 2014	I 2013	I 2014	I 2013	I 2014	I 2013
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	70,00	25,00	72,74	26,58	62,47	23,34	79,40	28,00
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	346,11	303,91	372,81	333,19	343,72	304,30	388,69	348,68
davon gattungsklassische	343,86	301,66	370,54	330,92	341,46	302,03	386,42	346,41
davon sonstige Deckungswerte	2,25	2,25	2,27	2,27	2,27	2,27	2,27	2,27
Überdeckung in %	394,44%	1.115,63	412,55%	1.153,69	450,22%	1203,92	389,50%	1.145,27
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			3,12%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2014		Laufzeitstruktur I 2013		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2014	I 2013
bis zu einem Jahr	94,90	-	15,93	0,00	94,90	15,93
mehr als 1 Jahr bis zu 2 Jahren	20,99	-	21,55	0,00	20,99	21,55
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	30,47	5,00	22,91	0,00	25,47	22,91
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	23,38	-	32,40	0,00	23,38	32,40
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	18,27	25,00	24,80	0,00	-6,73	24,80
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	133,48	40,00	133,76	25,00	93,48	108,76
über 10 Jahre	24,62	-	52,56	0,00	24,62	52,56

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

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

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2014	I 2013	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	
			I 2014	I 2013
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	346,11	303,91		
			<b>weitere Deckungen</b>	
			nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-
			höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-
<b>Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen</b>				
	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
Bundesrepublik Deutschland	-	29,89	139,51	176,71
Bundesrepublik Deutschland	-	30,82	90,73	182,36

### IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2014	I 2013			
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	-	-			
<b>Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen</b>					
	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	<b>Summe</b>
	-	-	-	-	-