

# Sparkasse Holstein

## Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag	I 2015
Referenz	I 2014

### 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)	
	I 2015	I 2014	I 2015	I 2014	I 2015	I 2014	I 2015	I 2014
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	120,00	70,00	127,02	72,74	114,24	62,47	128,75	79,40
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	354,45	346,11	388,84	372,81	359,39	343,72	393,02	388,69
davon gattungsklassische Deckungswerte	350,45	343,86	384,82	370,54	355,42	341,46	388,99	386,42
davon sonstige Deckungswerte	4,00	2,25	4,03	2,27	3,96	2,27	4,03	2,27
Überdeckung in %	195,37%	394,44%	206,13%	412,55%	214,60%	450,22%	205,26%	389,50%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG)			3,17%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2015		Laufzeitstruktur I 2014		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2015	I 2014
bis zu sechs Monate	88,52	-	94,90	-	88,52	94,90
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	6,39	-	-	-	6,39	-
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	21,09	-	20,99	-	21,09	20,99
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	8,94	5,00	-	-	3,94	-
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	24,43	-	30,47	5,00	24,43	25,47
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	18,58	75,00	23,38	-	56,42	23,38
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	29,85	10,00	18,27	25,00	19,85	6,73
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	126,57	30,00	133,48	40,00	96,57	93,48
über 10 Jahre	30,08	-	24,62	-	30,08	24,62

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)

Deckung nach	I 2015				I 2014			
	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)	
	I 2015	I 2014	I 2015	I 2014
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	I 2015	I 2014	I 2015	I 2014	I 2015	I 2014
keine	-	-	-	-	-	-

	I 2015	I 2014
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	69,36%	**
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	I 2015	I 2014
	354,45	346,11

Weitere Deckungswerte (Anteil am Pfandbriefumlauf)	I 2015	I 2014
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	I 2015	-	31,25	158,38	163,81
Spanien	I 2015	1,00	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	I 2014	-	29,89	139,51	176,71
Spanien	I 2014	-	-	-	-

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

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2015	I 2014
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
keine	I 2015	-	-	-	-	-
keine	I 2014	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Quartal	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe
keine	I 2015	-	-	-	-	-
keine	I 2014	-	-	-	-	-