

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe
ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	IV 2013
Referenz	IV 2012

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)	
	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012	IV 2013	IV 2012
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	50,00	25,00	50,78	26,65	44,56	23,27	54,96	28,00
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	342,22	294,46	364,17	323,68	335,05	294,28	384,27	338,14
davon gattungsklassische	339,97	293,71	361,89	322,92	332,78	293,53	382,00	337,39
davon sonstige Deckungswerte	2,25	0,75	2,28	0,76	2,27	0,76	2,27	0,76
Überdeckung in %	584,43%	1077,82%	617,19%	1114,33%	651,92%	1164,72%	599,17%	1107,64%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			4,48%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2013		Laufzeitstruktur IV 2012		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2013	IV 2012
bis zu einem Jahr	94,42	0,00	14,93	0,00	94,42	14,93
mehr als 1 Jahr bis zu 2 Jahren	20,71	0,00	20,54	0,00	20,71	20,54
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	30,12	5,00	21,87	0,00	25,12	21,87
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	16,27	0,00	31,36	0,00	16,27	31,36
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	24,47	25,00	16,90	0,00	-0,53	16,90
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	132,19	20,00	135,18	25,00	112,19	110,18
über 10 Jahre	24,04	0,00	53,66	0,00	24,04	53,66

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)

	IV 2013	IV 2012	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		IV 2013	IV 2012
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	342,22	294,46				
			weitere Deckungen			
			nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto		0,00	0,00
			höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut		0,00	0,00
Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner		
Bundesrepublik Deutschland	-	29,89	135,77	176,56	IV 2013	
andere Länder	-	-	-	-	IV 2013	
Bundesrepublik Deutschland	-	29,61	82,14	182,70	IV 2012	
andere Länder	-	-	-	-	IV 2012	

IV) Übersicht über rückständige Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2013	IV 2012				
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Forderungen	0,00	0,00				
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Summe	
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	