

# Sparkasse Holstein

## Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag: III 2020  
Referenz: III 2019

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	40,00	40,00	43,24	44,02	40,08	39,98	46,71	48,58
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	157,31	206,47	168,09	226,80	154,89	203,23	187,74	261,82
davon gattungsklassische Deckungswerte	150,31	196,97	160,09	215,64	147,50	193,12	179,07	249,49
davon sonstige Deckungswerte	7,00	9,50	8,00	11,16	7,39	10,11	8,67	12,34
Überdeckung in %	293,27%	416,17%	288,76%	415,17%	286,45%	408,31%	301,90%	438,99%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			18,51%					

\*Der Risikobarwert wird nach statischem Verfahren gem. Pfandbrief-Barwertverordnung ermittelt (Zinskurve + / - 250 BP)

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2020			III 2019		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	44,89	5,00	39,89	53,45	5,00	48,45
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	11,36	-	11,36	3,70	-	3,70
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	3,15	-	3,15	7,63	-	7,63
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	2,85	-	2,85	11,99	-	11,99
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	11,38	10,00	1,38	8,29	-	8,29
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	19,25	20,00	- 0,75	13,72	10,00	3,72
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	18,41	-	18,41	21,98	20,00	1,98
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	30,06	5,00	25,06	48,41	5,00	43,41
über 10 Jahre	15,95	-	15,95	37,28	-	37,28

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2020	III 2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	60,93%	66,32%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

Barwerte je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
keine	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	III 2020				III 2019			
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf
§20 PfandBG Abs. 2 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-
§20 PfandBG Abs. 2 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach Art der gesetzlichen Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen*	
	III 2020	III 2019	III 2020	III 2019
keine	-	-	-	-

\* i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1-2 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	III 2020	III 2019
bis zu 10 Millionen €	63,63	61,25
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	93,68	145,21
mehr als 100 Millionen €	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	III 2020	-	1,00	84,79	36,52	122,31
Rumänien	III 2020	6,00	-	-	-	6,00
Bundesrepublik Deutschland	III 2019	-	1,50	84,11	38,92	124,53
Rumänien	III 2019	8,00	-	-	-	8,00

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	III 2020	-	20,75	8,24	-	28,99
Bundesrepublik Deutschland	III 2019	-	44,62	29,32	-	73,94

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	III 2020	-	21,75	93,04	36,52	151,31
Rumänien	III 2020	6,00	-	-	-	6,00
Bundesrepublik Deutschland	III 2019	-	46,12	113,43	38,92	198,47
Rumänien	III 2019	8,00	-	-	-	8,00

Weitere Deckungswerte	III 2020	Anteil am Pfandbriefumlauf	III 2019	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
<b>Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen</b>	<b>157,31</b>	<b>393,27%</b>	<b>206,47</b>	<b>516,17%</b>

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

V) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 zu rückständigen Forderungen

(Angaben in Mio. Euro)

Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen auf Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
	III 2020	-	-	-	-	-
	III 2019	-	-	-	-	-
Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
	III 2020	-	-	-	-	-
	III 2019	-	-	-	-	-