

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag: II 2015
Referenz: II 2014

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	II 2015	II 2014	II 2015	II 2014	II 2015	II 2014	II 2015	II 2014
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	120,00	70,00	125,04	74,17	113,07	64,91	128,28	78,78
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	348,32	342,70	373,29	368,46	345,12	338,85	381,28	380,11
davon gattungsklassische Deckungswerte	344,32	340,45	369,26	366,19	341,16	336,59	377,25	377,84
davon sonstige Deckungswerte	4,00	2,25	4,03	2,27	3,97	2,26	4,03	2,27
Überdeckung in %	190,26%	389,58%	198,53%	396,81%	205,24%	422,04%	197,23%	382,50%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			3,22%					

*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)

	II 2015			II 2014		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	81,15	-	81,15	82,20	-	82,20
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	20,34	-	20,34	14,38	-	14,38
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	9,69	5,00	4,69	6,61	-	6,61
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	14,59	-	14,59	20,56	-	20,56
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	18,69	15,00	3,69	24,72	5,00	19,72
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	36,60	70,00	- 33,40	13,79	15,00	- 1,21
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	35,35	-	35,35	20,65	20,00	0,65
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	102,78	30,00	72,78	136,35	30,00	106,35
über 10 Jahre	29,13	-	29,13	23,46	-	23,46

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

(Angaben in Mio. Euro)

	II 2015	II 2014
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	68,71%	68,01%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	91,67%	85,71%

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

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	II 2015				II 2014			
	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*	
	II 2015	II 2014	II 2015	II 2014
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	II 2015	II 2014*
bis zu 10 Millionen €	83,07	
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	265,24	
mehr als 100 Millionen €	-	

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	II 2015	-	31,25	164,28	151,78	347,32
Spanien	II 2015	1,00	-	-	-	1,00
Bundesrepublik Deutschland	II 2014	-	29,89	147,91	164,90	342,70
Spanien	II 2014	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte	II 2015	Anteil am Pfandbriefumlauf	II 2014	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	348,32	290,26%	342,70	489,58%

* Neue Tabelle für die keine Vorjahreswerte vorliegen.

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	Gesamtbetrag	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
keine	II 2015	-	-	-	-	-
keine	II 2014	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamtbetrag	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
keine	II 2015	-	-	-	-	-
keine	II 2014	-	-	-	-	-