

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag: IV 2018
Referenz: IV 2017

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	45,00	60,00	48,70	64,29	44,08	58,52	53,98	65,35
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	341,95	341,85	360,97	359,48	329,72	331,18	404,66	366,87
davon gattungsklassische Deckungswerte	332,45	329,55	349,81	347,06	319,76	319,78	392,13	354,33
davon sonstige Deckungswerte	9,50	12,30	11,15	12,42	9,96	11,40	12,53	12,54
Überdeckung in %	659,89%	469,74%	641,22%	459,16%	648,08%	465,91%	649,61%	461,36%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			22,90%					

*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)

	IV 2018			IV 2017		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	70,36	10,00	60,36	64,68	15,00	49,68
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	39,20	-	39,20	22,07	-	22,07
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	10,90	-	10,90	4,40	10,00	5,60
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	4,69	-	4,69	48,29	-	48,29
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	48,12	-	48,12	15,48	-	15,48
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	31,85	-	31,85	50,00	-	50,00
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	19,78	10,00	9,78	37,45	-	37,45
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	60,88	25,00	35,88	58,20	35,00	23,20
über 10 Jahre	56,18	-	56,18	41,29	-	41,29

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

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2018	IV 2017
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	79,29%	76,47%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

Barwerte je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
keine	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	IV 2018				IV 2017			
	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*	
	IV 2018	IV 2017	IV 2018	IV 2017
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	IV 2018	IV 2017
bis zu 10 Millionen €	60,99	84,56
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	280,96	257,28
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	IV 2018	-	1,50	149,07	106,69	257,26
Rumänien	IV 2018	8,00	-	-	-	8,00
Bundesrepublik Deutschland	IV 2017	-	12,30	152,33	123,14	287,77

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	IV 2018	-	46,17	30,52	-	76,69
Bundesrepublik Deutschland	IV 2017	-	22,20	31,87	-	54,08

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	IV 2018	-	47,67	179,59	106,69	333,95
Rumänien	IV 2018	8,00	-	-	-	8,00
Bundesrepublik Deutschland	IV 2017	-	34,50	184,20	123,14	341,85

Weitere Deckungswerte	IV 2018	Anteil am Pfandbriefumlauf	IV 2017	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	341,95	759,89%	341,85	569,74%

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
keine	IV 2018	-	-	-	-	-
keine	IV 2017	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
keine	IV 2018	-	-	-	-	-
keine	IV 2017	-	-	-	-	-