

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag: I 2021
Referenz: I 2020

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	40,00	40,00	42,73	43,25	39,66	39,67	46,07	47,23
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	143,89	197,31	151,67	214,92	140,30	192,62	168,37	247,81
davon gattungsklassische Deckungswerte	141,89	189,81	149,50	206,24	138,24	184,65	166,07	238,34
davon sonstige Deckungswerte	2,00	7,50	2,18	8,68	2,06	7,98	2,30	9,47
Überdeckung in %	259,72%	393,29%	254,96%	396,95%	253,74%	385,51%	265,50%	424,70%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			5,10%					

*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)

	I 2021			I 2020		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	48,68	-	48,68	46,55	-	46,55
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	3,14	-	3,14	7,74	-	7,74
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	2,84	-	2,84	12,11	-	12,11
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	3,87	-	3,87	3,92	-	3,92
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	15,93	35,00	- 19,07	9,58	-	9,58
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	14,19	-	14,19	17,55	35,00	- 17,45
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	12,35	-	12,35	20,80	-	20,80
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	29,80	5,00	24,80	42,77	5,00	37,77
über 10 Jahre	13,08	-	13,08	36,31	-	36,31

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

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2021	I 2020
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	59,07%	67,31%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

Barwerte je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
keine	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	I 2021				I 2020			
	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*	
	I 2021	I 2020	I 2021	I 2020
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	I 2021	I 2020
bis zu 10 Millionen €	53,37	62,19
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	90,51	135,13
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	I 2021	-	1,00	82,76	34,69	118,45
Rumänien	I 2021	1,00	-	-	-	1,00
Bundesrepublik Deutschland	I 2020	-	1,50	83,09	38,33	122,92
Rumänien	I 2020	6,00	-	-	-	6,00

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	I 2021	-	19,88	4,55	-	24,44
Bundesrepublik Deutschland	I 2020	-	43,56	24,84	-	68,40

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	I 2021	-	20,88	87,32	34,69	142,89
Rumänien	I 2021	1,00	-	-	-	1,00
Bundesrepublik Deutschland	I 2020	-	45,06	107,93	38,33	191,31
Rumänien	I 2020	6,00	-	-	-	6,00

Weitere Deckungswerte	I 2021	Anteil am Pfandbriefumlauf	I 2020	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	143,89	359,72%	197,31	493,29%

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
	I 2021	-	-	-	-	-
	I 2020	-	-	-	-	-
Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
	I 2021	-	-	-	-	-
	I 2020	-	-	-	-	-