

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag: IV 2017
Referenz: IV 2016

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	60,00	60,00	64,29	65,63	58,52	58,38	65,35	66,51
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	341,85	358,79	359,48	381,27	331,18	350,40	366,87	386,02
davon gattungsklassische Deckungswerte	329,55	357,29	347,06	379,77	319,78	348,89	354,33	384,52
davon sonstige Deckungswerte	12,30	1,50	12,42	1,51	11,40	1,50	12,54	1,50
Überdeckung in %	469,74%	497,98%	459,16%	480,92%	465,91%	500,18%	461,36%	480,38%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			19,32%					

*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 2017			IV 2016		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	64,68	15,00	49,68	77,84	-	77,84
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	22,07	-	22,07	9,33	-	9,33
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	4,40	10,00	- 5,60	12,06	15,00	- 2,94
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	48,29	-	48,29	29,46	-	29,46
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	15,48	-	15,48	51,86	10,00	41,86
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	50,00	-	50,00	13,77	-	13,77
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	37,45	-	37,45	49,17	-	49,17
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	58,20	35,00	23,20	75,69	35,00	40,69
über 10 Jahre	41,29	-	41,29	39,61	-	39,61

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

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2017	IV 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	76,47%	73,46%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

Barwerte je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
keine	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	IV 2017				IV 2016			
	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 2017	IV 2016	IV 2017	IV 2016
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 2017	IV 2016
bis zu 10 Millionen €	84,56	61,62
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	257,28	297,17
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 2017	-	12,30	152,33	123,14	287,77
Spanien	IV 2017	-	-	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	IV 2016	-	-	-	-	-
Spanien	IV 2016	-	-	-	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -*	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	IV 2017	-	22,20	31,87	-	54,08
Spanien	IV 2017	-	-	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	IV 2016	-	-	-	-	-
Spanien	IV 2016	-	-	-	-	-

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 2017	-	34,50	184,20	123,14	341,85
Spanien	IV 2017	-	-	-	-	-
Bundesrepublik Deutschland	IV 2016	-	25,15	206,78	126,86	358,79
Spanien	IV 2016	0,00	-	-	-	0,00

Weitere Deckungswerte	IV 2017	Anteil am Pfandbriefumlauf	IV 2016	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	341,85	569,74%	358,79	597,98%

* 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	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
keine	IV 2017	-	-	-	-	-
keine	IV 2016	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Gesamt	Staat	Regionale Gebietskörper- schaften	Örtliche Gebietskörper- schaften	Sonstige Schuldner
keine	IV 2017	-	-	-	-	-
keine	IV 2016	-	-	-	-	-