

Sparkasse Holstein

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

Stichtag: III 2015
Referenz: III 2014

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert (Zinsanstieg)*		Risikobarwert (Zinsrückgang)*	
	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014	III 2015	III 2014
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	120,00	70,00	125,71	75,24	114,34	66,18	127,91	78,56
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	344,45	351,41	371,32	381,44	343,95	351,00	376,89	390,24
davon gattungsklassische Deckungswerte	340,45	349,16	367,29	379,17	339,99	348,74	372,86	387,97
davon sonstige Deckungswerte	4,00	2,25	4,03	2,26	3,96	2,26	4,03	2,26
Überdeckung in %	187,04%	402,02%	195,38%	406,94%	200,80%	430,37%	194,65%	396,72%
Sichernde Überdeckung (§ 4 Abs. 1 PfandBG) in %			3,20%					

*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 2015			III 2014		
	Deckung	Pfandbriefe	Überhang	Deckung	Pfandbriefe	Überhang
bis zu sechs Monate	75,45	-	75,45	81,40	-	81,40
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	21,41	-	21,41	14,71	-	14,71
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	9,26	5,00	4,26	6,94	-	6,94
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	14,91	-	14,91	21,64	-	21,64
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	24,34	65,00	-	40,66	5,00	19,13
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	32,53	20,00	12,53	24,33	15,00	9,33
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	37,02	-	37,02	31,98	20,00	11,98
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	105,96	30,00	75,96	119,56	30,00	89,56
über 10 Jahre	23,56	-	23,56	26,71	-	26,71

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2015	III 2014
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	70,44%	69,03%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	91,67%	85,71%

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

Weitere Deckung nach § 20 Abs. 2 Nr. 1-2	III 2015				III 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*	
	III 2015	III 2014	III 2015	III 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	III 2015	III 2014*
bis zu 10 Millionen €	79,85	
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	264,60	
mehr als 100 Millionen €	-	

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Stichtag	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Gesamt
Bundesrepublik Deutschland	III 2015	-	28,37	163,66	151,42	343,45
Spanien	III 2015	1,00	-	-	-	1,00
Bundesrepublik Deutschland	III 2014	-	29,89	156,98	164,54	351,41
Spanien	III 2014	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte	III 2015	Anteil am Pfandbriefumlauf	III 2014	Anteil am Pfandbriefumlauf
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-	-	-
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	344,45	287,04%	351,41	502,02%

* 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 Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner
keine	III 2015	-	-	-	-	-
keine	III 2014	-	-	-	-	-

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