

# Sparkasse KölnBonn

Stand per 31.12.2016

## Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	IV 2016	Referenz	IV 2015
----------	---------	----------	---------

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert *) (Verschieb. nach oben)		Risikobarwert *) (Verschieb. nach unten)	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	47,20	75,20	57,83	87,49	51,39	79,71	58,28	89,29
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	255,99	331,59	284,91	366,05	247,82	320,00	293,61	383,96
davon gattungsklassische Deckungswerte	250,99	326,59	279,36	360,58	243,00	315,36	287,99	378,26
davon weitere Deckungswerte	5,00	5,00	5,55	5,47	4,82	4,64	5,61	5,70
Überdeckung in %	442,34%	340,95%	392,66%	318,40%	382,25%	301,47%	403,74%	330,01%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			9,60%					

### II) Angaben gemäß § 28 Abs.1 Nr. 2 Pfandbriefgesetz zu Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfristen der Deckungsmasse

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur IV 2016		Laufzeitstruktur Referenz		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	IV 2016	IV 2015
bis zu sechs Monate	6,28	-	18,02	23,00	6,28	- 4,98
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	5,48	-	12,85	5,00	5,48	7,85
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	7,40	-	8,73	-	7,40	8,73
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	6,74	-	7,94	-	6,74	7,94
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	28,39	11,00	25,85	-	17,39	25,85
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	33,65	-	32,71	11,00	33,65	21,71
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	21,11	-	44,77	-	21,11	44,77
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	118,59	36,20	149,52	36,20	82,39	113,32
über 10 Jahre	28,34	-	31,19	-	28,34	31,19

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

\*) nach statischem Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse) (Angaben in Mio. Euro, wenn absolute Werte)

Deckung nach	IV 2016				IV 2015			
	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 gesetzl. Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	I 2017	I 2016	I 2017	I 2016
keine	-	-	-	-
<b>Summe</b>	-	-	-	-

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

	IV 2016	IV 2015
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	89,58%	88,71%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

### IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2016	IV 2015
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	255,99	331,59

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	IV 2016	IV 2015
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	IV 2016	IV 2015
bis zu 10 Millionen €	40,98	75,93
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	215,01	255,66
mehr als 100 Millionen €	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015	IV 2016	IV 2015
Bundesrepublik Deutschland	-	-	25,00	25,00	202,73	242,36	28,26	64,23	<b>255,99</b>	331,59
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 3 Nr. 2

(Angaben in Mio. Euro)

	IV 2016	IV 2015
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-
Gesamtbetrag der Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	-	-

Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe
	-	-	-	-	-

Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe
	-	-	-	-	-