

Stichtag	III 2021	Referenz	III 2020
----------	----------	----------	----------

Sparkasse KölnBonn

Stand per 30.09.2021

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

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)	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	36,20	36,20	38,87	40,54	37,63	38,33	40,18	42,90
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	245,66	334,98	266,24	364,29	243,59	334,55	301,39	403,45
davon gattungsklassische Deckungswerte	240,66	329,98	261,04	358,97	238,55	329,52	296,01	397,82
davon weitere Deckungswerte	5,00	5,00	5,21	5,32	5,04	5,03	5,38	5,63
Überdeckung in %	578,63%	825,36%	584,89%	798,65%	547,33%	772,89%	650,02%	840,35%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			13,39%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2021		Laufzeitstruktur Referenz		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2021	III 2020
bis zu sechs Monate	10,00	-	65,90	-	10,00	65,90
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	19,02	20,00	31,77	-	0,98	31,77
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	11,42	11,20	9,93	-	0,22	9,93
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,57	-	19,01	20,00	20,57	0,99
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	37,62	-	31,98	11,20	37,62	20,78
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	74,96	5,00	37,92	-	69,96	37,92
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	24,63	-	74,96	5,00	24,63	69,96
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	22,08	-	45,10	-	22,08	45,10
über 10 Jahre	25,37	-	18,40	-	25,37	18,40

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	III 2021				III 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 gesetzl. Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

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

	III 2021	III 2020
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	88,51%	79,87%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 & 2 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2021	III 2020
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	245,66	334,98

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	III 2021	III 2020
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	III 2021	III 2020
bis zu 10 Millionen €	58,05	49,29
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	187,61	285,69
mehr als 100 Millionen €	-	+

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	+	5,00	5,00	199,95	248,50	32,13	75,08	237,08	328,58

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	+	8,58	6,40	-	+	-	+	8,58	6,40

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020	III 2021	III 2020
Bundesrepublik Deutschland	-	+	13,58	11,40	199,95	248,50	32,13	75,08	245,66	334,98

	III 2021	III 2020
darunter ECA-Finanzierungen	-	+

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2021	III 2020			
Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	-	-			
Gesamtbetrag der Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag	-	-			
Rückständige Forderungen nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe
	-	-	-	-	-
Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe
	-	-	-	-	-