

Stichtag	I 2019	Referenz	I 2018
----------	--------	----------	--------

Sparkasse KölnBonn

Stand per 31.03.2019

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)	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	47,20	47,20	54,42	55,69	50,75	50,86	58,48	61,19
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	358,71	344,63	388,97	370,38	352,44	331,55	438,19	424,59
davon gattungsklassische Deckungswerte	343,71	339,63	372,60	365,02	337,71	326,78	419,98	418,56
davon weitere Deckungswerte	15,00	5,00	16,38	5,36	14,73	4,77	18,21	6,02
Überdeckung in %	659,98%	630,15%	614,75%	565,03%	594,51%	551,87%	649,34%	593,84%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			30,09%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur I 2019		Laufzeitstruktur Referenz		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	I 2019	I 2018
bis zu sechs Monate	14,83	11,00	9,02	-	3,83	9,02
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	13,21	-	11,93	-	13,21	11,93
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	6,89	-	7,22	11,00	6,89	-3,78
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	58,57	-	13,08	-	58,57	13,08
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	39,97	-	65,73	-	39,97	65,73
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	28,56	31,20	24,75	-	-2,64	24,75
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	33,98	-	29,11	31,20	33,98	-2,09
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	144,47	5,00	165,01	5,00	139,47	160,01
über 10 Jahre	18,23	-	18,78	-	18,23	18,78

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	I 2019				I 2018			
	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 2019	I 2018	I 2019	I 2018
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
keine	-	-	-	-	-	-

	I 2019	I 2018
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	83,21%	81,31%
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)

	I 2019	I 2018
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	358,71	344,63

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	I 2019	I 2018
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	I 2019	I 2018
bis zu 10 Millionen €	58,87	52,87
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	196,65	180,54
mehr als 100 Millionen €	103,19	111,22

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
Bundesrepublik Deutschland	-	÷	15,00	5,00	262,96	264,60	80,75	75,03	358,71	344,63

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
	-	÷	-	÷	-	÷	-	÷	-	÷

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018	I 2019	I 2018
Bundesrepublik Deutschland	-	÷	15,00	5,00	262,96	264,60	80,75	75,03	358,71	344,63

	I 2019	I 2018
darunter ECA-Finanzierungen	-	÷

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

(Angaben in Mio. Euro)

	I 2019	I 2018			
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
	-	-	-	-	-