

Stichtag	III 2017	Referenz	III 2016
----------	----------	----------	----------

Sparkasse KölnBonn

Stand per 30.09.2017

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 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	47,20	47,20	55,91	58,66	50,44	51,82	56,52	58,50
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	351,68	259,27	380,61	295,45	338,72	255,59	393,11	299,12
davon gattungsklassische Deckungswerte	346,68	254,27	375,17	289,82	333,92	250,74	387,58	293,51
davon weitere Deckungswerte	5,00	5,00	5,45	5,63	4,80	4,85	5,53	5,61
Überdeckung in %	645,08%	449,30%	580,82%	403,67%	571,57%	393,25%	595,58%	411,36%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. I PfandBG in %			9,74%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur III 2017		Laufzeitstruktur Referenz		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	III 2017	III 2016
bis zu sechs Monate	71,46	-	6,00	-	71,46	6,00
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	9,73	-	5,40	-	9,73	5,40
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	11,09	-	5,46	-	11,09	5,46
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	6,38	11,00	7,11	-	-4,62	7,11
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	18,43	-	25,36	11,00	18,43	14,36
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	35,57	-	26,00	-	35,57	26,00
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	23,00	20,00	33,38	-	3,00	33,38
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	146,90	16,20	121,60	36,20	130,70	85,40
über 10 Jahre	29,11	-	28,96	-	29,11	28,96

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 2017				III 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 gesetzl. Begrenzung	§20 Abs. 2 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

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

	III 2017	III 2016
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	81,49%	89,57%
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)

	III 2017	III 2016
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	351,68	259,27

Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	III 2017	III 2016
weitere Deckungen		
nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto	-	-
höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	III 2017	III 2016
bis zu 10 Millionen €	54,51	41,91
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	182,03	217,36
mehr als 100 Millionen €	115,14	-

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Bundesrepublik Deutschland	-	÷	5,00	25,00	270,61	205,49	76,07	28,79	351,68	259,27

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
	-	÷	-	÷	-	÷	-	÷	-	÷

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016	III 2017	III 2016
Bundesrepublik Deutschland	-	÷	5,00	25,00	270,61	205,49	76,07	28,79	351,68	259,27

	III 2017	III 2016
darunter ECA-Finanzierungen	-	÷

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

(Angaben in Mio. Euro)

	III 2017	III 2016			
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
	-	-	-	-	-