

Sparkasse KölnBonn

Stand per 30.06.2022

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	II 2022
Referenz	II 2021

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	31,20	36,20	32,97	39,92	32,43	38,44
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	257,29	260,88	258,59	283,02	238,89	258,95
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	724,66%	620,66%	684,34%	608,92%	636,57%	573,67%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
bis zu sechs Monate	26,20	-	6,66	22,00
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	0,00	5,00	25,77	19,38
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	26,20	6,15	6,01
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,00	-	35,16	25,80
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	-	58,75	39,62
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	5,00	-	57,41	57,86
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	5,00	15,54	42,27
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,00	-	26,67	22,32
über 10 Jahre	0,00	-	25,18	25,62

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	II 2022	II 2021
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	89,43%	89,05%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

Sparkasse KölnBonn

Stand per 30.06.2022

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs (nominal)	II 2022		II 2021	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Gesamte Deckungsmasse	257,29	824,66%	260,88	620,66%
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	257,29	824,66%	255,88	606,85%
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	29,25	93,75%	0,00	0,00%
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	0,00	0,00%	5,00	13,81%
davon Sichernde Überdeckung nach § 20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00%	0,00	0,00%

§28 (3) Nr.1 PfandBG Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	II 2022	II 2021
bis zu 10 Millionen €	51,61	58,79
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	205,68	202,09
mehr als 100 Millionen €	0,00	0,00

§28 (3) Nr. 2 Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen		Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		GESAMT	darin enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung
		geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von		
Land	II 2022	0,25	0,00	29,00	8,58	181,15	2,46	35,85	0,00	257,29	0,00
	II 2021	0,00	0,00	5,00	8,58	214,68	0,00	32,62	0,00	260,88	0,00
DECKUNGS-WERTE, GESAMT	II 2022	0,25	0,00	29,00	8,58	181,15	2,46	35,85	0,00	257,29	0,00
	II 2021	0,00	0,00	5,00	8,58	214,68	0,00	32,62	0,00	260,88	0,00

Sparkasse KölnBonn

Stand per 30.06.2022

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	II 2022	II 2021
§20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 4 und 5 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. §20 (2) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §20 (2) Nr. 2 PfandBG				Summe	
			Gesamt		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013			
	Staat	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021	II 2022	II 2021
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00