

Sparkasse Hannover

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)	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	719,10	819,10	821,89	888,11	773,50	842,29	874,48	938,08
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	1.151,37	1.176,80	1.342,32	1.288,34	1.259,22	1.214,92	1.437,47	1.372,74
davon gattungsklassische Deckungswerte	1.111,37	1.136,80	1.285,17	1.236,49	1.207,26	1.167,51	1.374,16	1.315,56
davon weitere Deckungswerte	40,00	40,00	57,16	51,86	51,96	47,41	63,31	57,18
Überdeckung in %	60,11%	43,67%	63,32%	45,07%	62,79%	44,24%	64,38%	46,33%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			6,95%					

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

	Laufzeitstruktur 30.09.2019		Laufzeitstruktur 30.09.2018		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	30.09.2019	30.09.2018
bis zu sechs Monate	317,44	11,00	321,63	160,00	306,44	161,63
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	100,80	-	30,52	-	100,80	30,52
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	24,87	-	63,12	1,00	24,87	62,12
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	25,58	-	90,00	-	25,58	90,00
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	50,56	122,00	48,81	-	-71,44	48,81
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	53,83	75,00	48,53	122,00	-21,17	-73,47
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	50,66	-	51,93	75,00	50,66	-23,07
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	230,46	328,00	218,07	318,00	-97,54	-99,93
über 10 Jahre	297,17	183,10	304,19	143,10	114,07	161,09

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

*) nach dynamischem 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	30.09.2019				30.09.2018			
	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert netto	Anteil am Umlauf	Nominal- wert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominal- wert 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	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
keine	-	-	-	-	-	-

	30.09.2019	30.09.2018
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,12%	98,22%
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)

	30.09.2019		30.09.2018	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	1.151,37	1.176,80		
weitere Deckungen	am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs		30.09.2019	30.09.2018
	nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto		-	-
	höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut		-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	30.09.2019	30.09.2018
bis zu 10 Millionen €	138,39	121,81
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	586,63	598,45
mehr als 100 Millionen €	426,35	456,54

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
Bundesrepublik Deutschland	20,00	20,00	20,00	20,00	853,41	894,42	34,09	34,10	927,50	968,51

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
Bundesrepublik Deutschland	-	-	55,00	55,00	168,87	153,29	-	-	223,87	208,29

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2019	30.09.2018
Bundesrepublik Deutschland	20,00	20,00	75,00	75,00	1.022,28	1.047,71	34,09	34,10	1.151,37	1.176,81

	30.09.2019	30.09.2018
darunter ECA-Finanzierungen	-	-

V) Übersicht über rückständige Forderungen gemäß §28 Abs. 3 Nr. 3 (Angaben in Mio. Euro)

	30.09.2019	30.09.2018
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
		-	-	-	-