

Sparkasse Hannover

Report zum Umlauf Öffentlicher Pfandbriefe
ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtete 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)	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	738,10	719,10	829,85	821,89	785,43	773,50	878,01	874,48
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	967,38	1.151,37	1.093,14	1.342,32	1.020,15	1.259,22	1.176,89	1.437,47
davon gattungsklassische Deckungswerte	921,88	1.111,37	1.046,32	1.285,17	975,33	1.207,26	1.127,89	1.374,16
davon weitere Deckungswerte	45,50	40,00	46,82	57,16	44,81	51,96	49,01	63,31
Überdeckung in %	31,06%	60,11%	31,73%	63,32%	29,88%	62,79%	34,04%	64,38%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			5,64%					

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

(in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur 30.09.2020		Laufzeitstruktur 30.09.2019		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	30.09.2020	30.09.2019
bis zu sechs Monate	267,02	10,00	317,44	11,00	257,02	306,44
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	24,62	-	100,80	-	24,62	100,80
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	34,50	46,50	24,87	-	12,00	24,87
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	20,33	75,50	25,58	-	55,17	25,58
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	46,13	75,00	50,56	122,00	28,87	-71,44
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	59,17	-	53,83	75,00	59,17	-21,17
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	45,93	285,00	50,66	-	239,07	50,66
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	226,64	118,00	230,46	328,00	108,64	-97,54
über 10 Jahre	243,04	128,10	297,17	183,10	114,94	114,07

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	30.09.2020				30.09.2019			
	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	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
keine	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
keine	-	-	-	-	-	-

	30.09.2020	30.09.2019
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	97,59%	97,12%
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)

	30.09.2020		30.09.2019	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	967,38	1.151,37		
Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs			30.09.2020	30.09.2019
weitere Deckungen			30.09.2020	30.09.2019
	nach § 20 Abs. 2 PfandBG brutto		-	-
	höchste Geldforderung gegen ein Kreditinstitut		-	-

Zur Deckung verwendete Forderungen nach Größenklassen	30.09.2020		30.09.2019	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
bis zu 10 Millionen €	148,11	138,39		
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	443,04	586,63		
mehr als 100 Millionen €	376,23	426,35		

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Bundesrepublik Deutschland	-	20,00	25,00	20,00	693,47	853,41	72,12	34,09	790,59	927,50

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	55,00	176,79	168,87	-	-	176,79	223,87

Deckungsmasse nach Ländern und Schuldnerklassen - geschuldet und gewährleistet von -	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
Bundesrepublik Deutschland	-	20,00	25,00	75,00	870,26	1.022,28	72,12	34,09	967,38	1.151,37

	30.09.2020	30.09.2019
darunter ECA-Finanzierungen	-	-

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

(Angaben in Mio. Euro)

	30.09.2020		30.09.2019							
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019						
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	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbeitrag nach Ländern und Schuldnerklassen	Staat		Regionale Gebietskörperschaften		Örtliche Gebietskörperschaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2020	30.09.2019
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-