

Die Sparkasse Bremen AG

Report zum Hypothekenpfandbriefumlauf

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	30.06.2021
Referenz	30.06.2020

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)	
	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020	30.06.2021	30.06.2020
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs	782,10	317,10	825,33	370,07	695,54	311,20	990,56	444,34
Gesamtbetrag der Deckungsmassen	929,46	717,59	1039,56	824,72	914,78	722,74	1193,02	950,63
davon gattungsklassische Deckungswerte	894,46	704,59	1003,15	810,21	881,04	710,34	1153,64	933,64
davon sonstige Deckungswerte	35,00	13,00	36,41	14,51	33,74	12,40	39,38	16,99
Überdeckung in %	18,84%	126,30%	25,96%	122,86%	31,52%	132,24%	20,43%	113,94%
Sichernde Überdeckung gem. § 4 Abs. 1 PfandBG in %			2,95%					

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

(Angaben in Mio. Euro)

	Laufzeitstruktur 30.06.2021		Laufzeitstruktur 30.06.2020		Überhang	
	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	Deckungs- masse	Pfandbrief- umlauf	30.06.2021	30.06.2020
bis zu sechs Monate	96,12	-	55,00	-	96,12	55,00
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	38,05	10,00	38,53	5,00	28,05	33,53
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	48,61	-	31,19	-	28,61	31,19
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	48,80	20,00	32,70	10,00	28,80	22,70
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	97,09	37,10	67,90	40,00	598,99	27,90
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	65,86	255,00	81,50	37,10	-189,14	44,40
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	74,46	40,00	60,44	5,00	34,46	55,44
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	316,21	180,00	233,98	110,00	136,20	123,98
über 10 Jahre	144,26	220,00	116,35	110,00	-75,74	6,35

In der Deckungsmasse befinden sich keine Derivate.

Statisches Verfahren gem. PfandBarwertV

III) Angaben gemäß § 28 Abs. 1 Nr. 4 ff. Pfandbriefgesetz (Zusammensetzung der Deckungsmasse)

(Angaben in Mio. Euro)

Weitere Deckung nach	30.06.2021				30.06.2020				gesetzl. Grenze
	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	Nominalwert brutto	davon nicht anrechenbar	Nominalwert netto	Anteil am Umlauf	
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 2	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%
§19 PfandBG Abs. 1 Nr. 3	12,00	-	12,00	1,53%	-	-	-	-	20,00%

Weitere Deckung nach Art der gesetzlichen Begrenzung	§19 Abs. 1 Nr. 2 PfandBG 10%-Grenze		davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Artikels 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013		§19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG 20%-Grenze		Summe	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-	22,00	-	22,00	-
Frankreich inkl. Monaco	-	-	-	-	5,00	5,00	5,00	5,00
Spanien	-	-	-	-	8,00	8,00	8,00	8,00
Summe	-	-	-	-	35,00	13,00	35,00	13,00

Nettobarwert je Fremdwährung	Barwert der Deckungsmassen		Barwert des Pfandbriefumlaufs		Nettobarwert in Fremdwährung	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
keine	-	-	-	-	-	-

	30.06.21	30.06.20
Prozentualer Anteil festverzinslicher Deckungswerte	93,19%	98,40%
Prozentualer Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	53,44%	52,88%
Überschreibungsbetrag hypothekarischer Deckung in Staaten bei denen Pfandbriefgläubigervorrecht nicht sichergestellt ist (§13 Abs. 1 PfandBG)	-	-
volumengewichteter Durchschnitt der seit Kreditvergabe verstrichenen Laufzeit	6,53	6,98

Die Sparkasse Bremen AG

Report zum Hypothekenpfandbriefumlauf

ohne Derivate, Auslandsgeschäfte sowie wertberichtigte Geschäfte

Stichtag	30.06.2021
Referenz	30.06.2020

IV) Angaben gemäß § 28 Abs. 2 Nr. 1 Pfandbriefgesetz zur Zusammensetzung der Deckungsmasse

(Angaben in Mio. Euro)

Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen	30.06.21	30.06.20	Anteil am Gesamtbetrag der Deckungsmasse	Gesamtbetrag der zur Deckung verwendeten Forderungen (sonstige Deckung)	30.06.21	30.06.20	Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs
nach Größenklassen				weitere Deckungswerte			
bis einschließlich 300 T€	603,65	605,59		weitere Deckung gem. § 19 Abs. 1 Nr. 2-3 PfandBG brutto	35,00	13,00	4,48%
mehr als 300 T€ bis einschließlich 1 Mio.€	76,74	50,72		davon nach § 19 Abs. 1 Nr.2 PfandBG	12,00	-	1,53%
mehr als 1 Mio.€ bis einschließlich 10 Mio.€	193,19	48,28		davon höchste Geldforderung geg. KI	-	-	
mehr als 10 Mio.€	20,88	-		Gesamtauslastung nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 PfandBG	12,00	-	1,53%
nach Nutzungsart (I) in Deutschland				Deckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG (für sichernde Überdeckung verwendet)			
wohnwirtschaftlich	679,27	660,98		Deckung ausschließlich für Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG	23,00	13,00	2,94%
gewerblich	215,19	43,61					
nach Nutzungsart (II) in Deutschland				Summe gattungsklassische und weitere Deckung			
			30.06.21		929,46	717,59	118,84%
Eigentumswohnungen	88,68	92,55	9,91%				
Ein- und Zweifamilienhäuser	457,84	448,48	51,19%				
Mehrfamilienhäuser	132,75	119,95	14,84%				
Bürogebäude	41,40	0,51	4,63%				
Handelsgebäude	6,95	1,60	0,78%				
Industriegebäude	43,36	13,02	4,85%				
sonstige gewerblich genutzte Gebäude	123,48	28,48	13,80%				
unfertige und nicht ertragsfähige Neubauten	-	-					
Bauplätze	-	-					

Außerhalb Deutschlands befinden sich keine Grundstückssicherheiten.

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

(Angaben in Mio. Euro)

Länder	Mindestens 90 Tage rückständige Leistungen		Forderungen mit mindestens 5% Rückstandsbetrag	
	30.06.21	30.06.20	30.06.21	30.06.20
Bundesrepublik Deutschland	-	-	-	-
Summe	-	-	-	-

Erläuterungen zu den im Report verwendeten Begriffen

Gattungsklassische Deckungswerte:	- Darlehensforderungen oder Schuldverschreibungen nach § 19 Abs. 1 PfandBG
Sonstige Deckungswerte:	- weitere Deckungswerte nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 und Nr. 3 PfandBG
	- sichernde Überdeckung nach § 4 Abs. 1 PfandBG
	- Liquiditätssicherung nach § 4 Abs. 1a PfandBG

