



# Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 31. März 2020

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
Deckungswerte	6.089,4	7.514,4	6.828,3	8.365,2	6.470,6	7.971,3
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	5.342,5	6.324,3	6.345,4	7.539,0	6.140,7	7.273,1
Überdeckung in %	14,0	18,8	7,6	11,0	5,4	9,6

\* dynamisches Verfahren

2. Laufzeitstruktur der im Umlauf befindlichen Schuldverschreibungen sowie Zinsbindungsfristen der verwendeten Deckungswerte (Nennwert):

	Deckungs- werte	Deckungs- werte	Schuldver- schreibungen	Schuldver- schreibungen
	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
bis zu 6 Monate	663,4	479,3	294,0	568,8
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	529,6	843,6	456,2	413,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	402,5	442,8	1.026,5	294,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	397,8	595,2	720,0	456,2
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.024,8	796,7	503,0	1.746,5
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	596,5	1.043,5	338,5	503,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	310,4	611,2	428,3	338,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	857,6	1.286,9	1.435,0	1.843,3
über 10 Jahre	1.306,8	1.415,2	141,0	161,0
<b>Summe</b>	<b>6.089,4</b>	<b>7.514,4</b>	<b>5.342,5</b>	<b>6.324,3</b>

3. Gesamtbetrag der Ersatzdeckung (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
Summe Bankgeldforderungen	283,0	0,0
<b>Gesamtsumme</b>	<b>283,0</b>	<b>0,0</b>



## 4. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	2.933,8	2.670,5
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	162,4	91,1
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	21,9	30,1
mehr als 10 Mio €	370,5	373,9
<b>Summe</b>	<b>3.488,6</b>	<b>3.165,6</b>

## 5. Zur Deckung des Umlaufs verwendete Anleihen und Schuldscheine nach Größengruppen (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	68,8	71,7
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	513,0	752,1
mehr als 100 Mio €	1.736,0	3.525,0
<b>Summe</b>	<b>2.317,8</b>	<b>4.348,8</b>

## 6. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen auf Hypothekenforderungen (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
Summe Deutschland	0,2	0,1
<b>Gesamtsumme</b>	<b>0,2</b>	<b>0,1</b>

Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Hypothekenforderung beträgt (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
Summe Deutschland	0,3	0,2
<b>Gesamtsumme</b>	<b>0,3</b>	<b>0,2</b>



7. Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen auf zur Deckung verwendete Anleihen und Schuldscheine (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
<b>Deutschland</b>		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Deutschland	0,0	0,0
<b>Gesamtsumme</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>

Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der zur Deckung verwendeten Anleihen und Schuldscheine beträgt (Nennwert):

	Q I 2020 Mio €	Q I 2019 Mio €
<b>Deutschland</b>		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Deutschland	0,0	0,0
<b>Gesamtsumme</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>

8. Kennzahlen zu umlaufenden Schuldverschreibungen und den dafür verwendeten Deckungswerten:

	Q I 2020	Q I 2019
<b>Zinsstruktur</b>		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0%	100,0 %
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	96,4%	95,4 %
<b>Weitere Kennzahlen</b>		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	7,5	9,0
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	51,7%	49,7 %



9. Zur Deckung der Schuldverschreibungen verwendete Anleihen und Schuldscheine (Nennwert) nach der Art des Schuldners bzw. der gewährleistenden Stelle und deren Sitz (Staat):

	<b>Q I 2020</b> <b>Mio €</b>	<b>Q I 2019</b> <b>Mio €</b>
<b>Deutschland</b>		
Staat	70,7	280,9
Regionale Gebietskörperschaft	1.339,5	2.694,5
Örtliche Gebietskörperschaft	48,0	54,7
Sonstige Schuldner	859,6	1.318,7
Summe Deutschland	2.317,8	4.348,8
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
<b>Gesamtsumme</b>	<b>2.317,8</b>	<b>4.348,8</b>