



Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 30. Juni 2019

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
Deckungswerte	6.848,8	8.451,6	7.537,4	9.255,7	7.207,4	8.903,9
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	5.899,3	7.433,8	7.069,0	8.763,6	6.816,0	8.446,3
Überdeckung in %	16,1	13,7	6,6	5,6	5,7	5,4

* dynamisches Verfahren

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

	Deckungs- werte	Deckungs- werte	Schuldver- schreibungen	Schuldver- schreibungen
	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
bis zu 6 Monate	868,1	721,2	307,8	681,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	542,7	692,0	416,0	853,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	364,7	819,3	473,2	307,8
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	402,0	556,4	840,0	466,0
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	834,9	897,6	1.191,5	1.263,2
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.264,6	862,2	400,0	1.191,5
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	518,0	1.379,9	351,5	400,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.119,3	1.728,1	1.778,3	2.019,8
über 10 Jahre	934,5	794,9	141,0	251,0
Summe	6.848,8	8.451,6	5.899,3	7.433,8



3. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	2.790,7	2.080,2
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	117,2	30,5
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	28,3	28,2
mehr als 10 Mio €	373,1	419,7
Summe	3.309,3	2.558,6

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

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	67,1	87,2
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	898,5	945,1
mehr als 100 Mio €	2.574,0	4.860,7
Summe	3.539,6	5.893,0

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

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
Summe Deutschland	0,4	0,0
Gesamtsumme	0,4	0,0

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

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
Summe Deutschland	0,0	0,2
Gesamtsumme	0,0	0,2

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

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
Deutschland		
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
Gesamtsumme	0,0	0,0



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

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
Deutschland		
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
Gesamtsumme	0,0	0,0

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

	Q II 2019	Q II 2018
Zinsstruktur		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0 %	100,0 %
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	94,1 %	95,0 %
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	8,6	11,2
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	50,3 %	46,7 %



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

	Q II 2019 Mio €	Q II 2018 Mio €
Deutschland		
Staat	255,9	286,3
Regionale Gebietskörperschaft	1.789,5	3.416,2
Örtliche Gebietskörperschaft	51,2	68,2
Sonstige Schuldner	1.294,0	1.808,3
Summe Deutschland	3.390,6	5.579,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
EU-Institutionen		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	149,0	50,0
Summe EU-Institutionen	149,0	50,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Irland		
Staat	0,0	250,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Irland	0,0	250,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Luxemburg		
Staat	0,0	14,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Luxemburg	0,0	14,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Gesamtsumme	3.539,6	5.893,0