



Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 30. September 2018

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
Deckungswerte	7.858,7	9.903,3	8.581,9	10.915,6	8.252,9	10.495,6
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	6.870,8	8.572,2	8.096,7	10.154,5	7.801,0	9.770,2
Überdeckung in %	14,4	15,5	6,0	7,5	5,8	7,4

* dynamisches Verfahren

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

	Deckungs- werte	Deckungs- werte	Schuldver- schreibungen	Schuldver- schreibungen
	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
bis zu 6 Monate	384,4	630,8	546,5	454,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	703,6	1.049,6	568,8	1.246,9
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	821,0	436,4	413,0	596,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	457,1	705,5	294,0	518,8
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.028,8	1.390,5	1.482,7	707,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	799,1	1.365,4	1.050,0	1.482,7
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.358,0	799,8	360,0	1.050,0
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.518,0	2.732,3	1.974,8	2.091,8
über 10 Jahre	788,7	793,0	181,0	424,0
Summe	7.858,7	9.903,3	6.870,8	8.572,2



3. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	2.003,2	2.423,2
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	28,8	35,8
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	27,9	44,4
mehr als 10 Mio €	442,1	363,5
Summe	2.502,0	2.866,9

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

	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	78,0	103,0
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	942,4	1.192,7
mehr als 100 Mio €	4.336,3	5.740,7
Summe	5.356,7	7.036,4

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

	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
Summe Deutschland	0,2	0,4
Gesamtsumme	0,2	0,4

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

	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
Summe Deutschland	0,4	0,7
Gesamtsumme	0,4	0,7

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

	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 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 III 2018 Mio €	Q III 2017 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 III 2018	Q III 2017
Zinsstruktur		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0%	100,0%
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	94,4%	93,9%
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	11,4	10,8
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	46,7%	46,9%



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

	Q III 2018 Mio €	Q III 2017 Mio €
Deutschland		
Staat	281,6	287,0
Regionale Gebietskörperschaft	3.355,9	4.041,2
Örtliche Gebietskörperschaft	62,0	126,7
Sonstige Schuldner	1.407,2	1.872,5
Summe Deutschland	5.106,7	6.327,4
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	0,0	145,0
Summe EU-Institutionen	0,0	145,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Finnland		
Staat	0,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	100,0
Summe Finnland	0,0	100,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Irland		
Staat	250,0	450,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Irland	250,0	450,0
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	5.356,7	7.036,4