



Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 31. Dezember 2019

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
Deckungswerte	6.522,4	7.722,5	7.224,5	8.433,8	6.831,3	8.110,2
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	5.591,5	6.752,3	6.616,6	7.967,5	6.398,2	7.687,2
Überdeckung in %	16,7	14,4	9,2	5,9	6,8	5,5

* dynamisches Verfahren

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

	Deckungs- werte	Deckungs- werte	Schuldver- schreibungen	Schuldver- schreibungen
	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
bis zu 6 Monate	919,4	406,6	466,0	853,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	331,9	822,0	423,2	307,8
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	414,0	562,0	840,0	416,0
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	562,2	426,7	766,5	473,2
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	937,6	1.120,0	743,0	1.606,5
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	773,0	1.191,0	298,5	743,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	241,0	927,3	330,0	298,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.009,7	1.487,7	1.583,3	1.873,3
über 10 Jahre	1.333,6	779,2	141,0	181,0
Summe	6.522,4	7.722,5	5.591,5	6.752,3

3. Gesamtbetrag der Ersatzdeckung (Nennwert):

	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
Summe Bankgeldforderungen	333,0	0,0
Gesamtsumme	333,0	0,0



4. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	3.020,9	1.929,8
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	164,3	28,0
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	24,9	28,9
mehr als 10 Mio €	371,6	441,3
Summe	3.581,7	2.428,0

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

	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	70,6	84,7
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	551,2	968,8
mehr als 100 Mio €	1.986,0	4.241,0
Summe	2.607,8	5.294,5

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

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

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

	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
Summe Deutschland	0,2	0,3
Gesamtsumme	0,2	0,3



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

	Q IV 2019 Mio €	Q IV 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 IV 2019 Mio €	Q IV 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

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

	Q IV 2019	Q IV 2018
Zinsstruktur		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0%	100,0%
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	96,5%	94,6%
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	7,4	11,5
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	51,7%	46,6%



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

	Q IV 2019 Mio €	Q IV 2018 Mio €
Deutschland		
Staat	70,7	281,7
Regionale Gebietskörperschaft	1.474,5	3.280,5
Örtliche Gebietskörperschaft	48,0	59,8
Sonstige Schuldner	1.014,6	1.422,5
Summe Deutschland	2.607,8	5.044,5
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	50,0
Summe Irland	0,0	50,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Irland		
Staat	0,0	200,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Irland	0,0	200,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Gesamtsumme	2.607,8	5.294,5