

Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 31. März 2018

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

| | Nennwert | Nennwert | Barwert | Barwert | Risikobarwert* | Risikobarwert* |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
| Deckungswerte | 9.276,2 | 11.493,0 | 10.135,8 | 12.782,1 | 9.758,7 | 12.167,5 |
| davon Derivate | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Schuldverschreibungen | 8.117,7 | 10.205,7 | 9.552,3 | 12.088,5 | 9.215,7 | 11.567,9 |
| Überdeckung in % | 14,3 | 12,6 | 6,1 | 5,7 | 5,9 | 5,2 |

* dynamisches Verfahren

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

| | Deckungswerte | Deckungswerte | Schuldverschreibungen | Schuldverschreibungen |
|--------------------------------------|-------------------|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
| bis zu 6 Monate | 1.080,0 | 852,2 | 1.246,9 | 1.633,5 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 426,1 | 495,2 | 596,5 | 454,5 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 699,4 | 1.035,6 | 518,8 | 1.246,9 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 902,4 | 495,3 | 413,0 | 596,5 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 1.324,0 | 1.912,1 | 750,2 | 931,8 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 815,9 | 1.465,7 | 1.746,5 | 750,2 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 1.228,9 | 917,5 | 503,0 | 1.746,5 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 1.990,2 | 3.394,1 | 2.008,8 | 2.261,8 |
| über 10 Jahre | 809,3 | 925,3 | 334,0 | 584,0 |
| Summe | 9.276,2 | 11.493,0 | 8.117,7 | 10.205,7 |

3. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
|---|-------------------|-------------------|
| bis einschließlich 300.000 € | 2.179,5 | 2.645,9 |
| mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio € | 30,9 | 37,4 |
| mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio € | 28,6 | 36,8 |
| mehr als 10 Mio € | 420,5 | 335,3 |
| Summe | 2.659,5 | 3.055,4 |

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

| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
|------------------------------------|-------------------|-------------------|
| bis einschließlich 10 Mio € | 89,2 | 115,3 |
| mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio € | 913,8 | 1.273,6 |
| mehr als 100 Mio € | 5.613,7 | 7.048,7 |
| Summe | 6.616,7 | 8.437,6 |

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

| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| Summe Deutschland | 0,1 | 0,2 |
| Gesamtsumme | 0,1 | 0,2 |

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

| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| Summe Deutschland | 0,1 | 0,5 |
| Gesamtsumme | 0,1 | 0,5 |

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

| | Q I 2018 Mio € | Q I 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 I 2018 Mio € | Q I 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 I 2018 | Q I 2017 |
|--|----------|----------|
| Zinsstruktur | | |
| Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen | 100,0 % | 100,0 % |
| Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | 93,2 % | 93,9 % |
| Weitere Kennzahlen | | |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio € | - | - |
| Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren | 11,0 | 10,6 |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | 46,9 % | 46,8 % |

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

| | Q I 2018 Mio € | Q I 2017 Mio € |
|---|-------------------|-------------------|
| Deutschland | | |
| Staat | 286,3 | 328,8 |
| Regionale Gebietskörperschaft | 3.864,2 | 5.277,8 |
| Örtliche Gebietskörperschaft | 69,3 | 81,5 |
| Sonstige Schuldner | 1.837,9 | 2.020,5 |
| Summe Deutschland | 6.057,7 | 7.708,6 |
| 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 | 95,0 | 145,0 |
| Summe EU-Institutionen | 95,0 | 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 | 450,0 | 450,0 |
| Regionale Gebietskörperschaft | 0,0 | 0,0 |
| Örtliche Gebietskörperschaft | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige Schuldner | 0,0 | 0,0 |
| Summe Irland | 450,0 | 450,0 |
| Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | 0,0 | 0,0 |
| Luxemburg | | |
| Staat | 14,0 | 34,0 |
| Regionale Gebietskörperschaft | 0,0 | 0,0 |
| Örtliche Gebietskörperschaft | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige Schuldner | 0,0 | 0,0 |
| Summe Luxemburg | 14,0 | 34,0 |
| Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | 0,0 | 0,0 |
| Gesamtsumme | 6.616,7 | 8.437,6 |