

Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 30. September 2017

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
Deckungswerte	9.903,3	12.077,4	10.915,6	13.724,2	10.495,6	13.124,3
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	8.572,2	10.748,2	10.154,5	12.960,0	9.770,2	12.449,9
Überdeckung in %	15,5	12,4	7,5	5,9	7,4	5,4

* dynamisches Verfahren

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

	Deckungswerte	Deckungswerte	Schuldverschreibungen	Schuldverschreibungen
	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
bis zu 6 Monate	630,8	1.030,5	454,5	542,5
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.049,6	712,6	1.246,9	1.633,5
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	436,4	472,4	596,5	454,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	705,5	1.033,7	518,8	1.246,9
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.390,5	1.121,5	707,0	1.115,3
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.365,4	1.621,7	1.482,7	707,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	799,8	1.442,1	1.050,0	1.482,7
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	2.732,3	3.688,5	2.091,8	2.956,8
über 10 Jahre	793,0	954,4	424,0	609,0
Summe	9.903,3	12.077,4	8.572,2	10.748,2

3. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	2.423,2	2.953,4
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	35,8	41,4
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	44,4	45,6
mehr als 10 Mio €	363,5	349,6
Summe	2.866,9	3.390,0

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

	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	103,0	125,7
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	1.192,7	1.327,4
mehr als 100 Mio €	5.740,7	7.234,3
Summe	7.036,4	8.687,4

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

	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
Summe Deutschland	0,4	0,1
Gesamtsumme	0,4	0,1

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

	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
Summe Deutschland	0,7	0,8
Gesamtsumme	0,7	0,8

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

	Q III 2017 Mio €	Q III 2016 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 2017 Mio €	Q III 2016 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 2017	Q III 2016
Zinsstruktur		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0%	100,0%
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	93,9%	94,9%
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	10,8	10,1
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	46,9%	47,2%

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 2017 Mio €	Q III 2016 Mio €
Deutschland		
Staat	287,0	353,0
Regionale Gebietskörperschaft	4.041,2	5.460,9
Örtliche Gebietskörperschaft	126,7	88,3
Sonstige Schuldner	1.872,5	2.492,2
Summe Deutschland	6.327,4	8.394,4
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	145,0	159,0
Summe EU-Institutionen	145,0	159,0
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	100,0	100,0
Summe Finnland	100,0	100,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Irland		
Staat	450,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Irland	450,0	0,0
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	7.036,4	8.687,4