

Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 31. Dezember 2016

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
Deckungswerte	12.004,5	12.758,5	13.452,7	14.154,6	12.821,0	13.496,9
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	10.688,2	11.074,4	12.699,3	13.352,2	12.179,6	12.716,2
Überdeckung in %	12,3	15,2	5,9	6,0	5,3	6,1

* dynamisches Verfahren

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

	Deckungswerte	Deckungswerte	Schuldverschreibungen	Schuldverschreibungen
	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
bis zu 6 Monate	892,0	1.001,6	1.158,5	326,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	508,4	1.062,4	1.128,5	60,3
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	716,4	1.049,9	967,4	1.158,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	626,9	556,1	681,5	1.128,5
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	1.844,3	1.294,4	1.160,8	1.648,9
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	1.559,2	1.733,9	889,2	1.160,8
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	1.298,1	1.210,6	1.606,5	889,1
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	3.607,0	3.830,9	2.486,8	3.511,3
über 10 Jahre	952,2	1.018,7	609,0	1.191,0
Summe	12.004,5	12.758,5	10.688,2	11.074,4

3. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	2.788,6	3.634,3
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	38,7	55,3
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	43,7	36,9
mehr als 10 Mio €	336,5	218,7
Summe	3.207,5	3.945,2

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

	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	118,0	136,0
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	1.241,3	1.019,3
mehr als 100 Mio €	7.437,7	7.658,0
Summe	8.797,0	8.813,3

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

	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
Summe Deutschland	0,2	0,1
Gesamtsumme	0,2	0,1

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

	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
Summe Deutschland	1,0	0,4
Gesamtsumme	1,0	0,4

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

	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 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 2016 Mio €	Q IV 2015 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 IV 2016	Q IV 2015
Zinsstruktur		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0	100,0
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	94,0	92,8
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	10,4	9,8
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	47,0	47,1

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

	Q IV 2016 Mio €	Q IV 2015 Mio €
Deutschland		
Staat	353,0	245,0
Regionale Gebietskörperschaft	5.591,9	4.883,4
Örtliche Gebietskörperschaft	82,9	238,2
Sonstige Schuldner	2.026,3	2.678,7
Summe Deutschland	8.054,0	8.045,3
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	235,0
Sonstige Schuldner	159,0	399,0
Summe EU-Institutionen	159,0	634,0
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	34,0	34,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Luxemburg	34,0	34,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Gesamtsumme	8.797,0	8.813,3