



Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 30. Juni 2019

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

| | Nennwert | Nennwert | Barwert | Barwert | Risikobarwert* | Risikobarwert* |
|-----------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
| Deckungswerte | 6.848,8 | 8.451,6 | 7.537,4 | 9.255,7 | 7.207,4 | 8.903,9 |
| davon Derivate | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Schuldverschreibungen | 5.899,3 | 7.433,8 | 7.069,0 | 8.763,6 | 6.816,0 | 8.446,3 |
| Überdeckung in % | 16,1 | 13,7 | 6,6 | 5,6 | 5,7 | 5,4 |

* dynamisches Verfahren

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

| | Deckungs- werte | Deckungs- werte | Schuldver- schreibungen | Schuldver- schreibungen |
|--------------------------------------|--------------------|--------------------|----------------------------|----------------------------|
| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
| bis zu 6 Monate | 868,1 | 721,2 | 307,8 | 681,5 |
| mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten | 542,7 | 692,0 | 416,0 | 853,0 |
| mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten | 364,7 | 819,3 | 473,2 | 307,8 |
| mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren | 402,0 | 556,4 | 840,0 | 466,0 |
| mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren | 834,9 | 897,6 | 1.191,5 | 1.263,2 |
| mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren | 1.264,6 | 862,2 | 400,0 | 1.191,5 |
| mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren | 518,0 | 1.379,9 | 351,5 | 400,0 |
| mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren | 1.119,3 | 1.728,1 | 1.778,3 | 2.019,8 |
| über 10 Jahre | 934,5 | 794,9 | 141,0 | 251,0 |
| Summe | 6.848,8 | 8.451,6 | 5.899,3 | 7.433,8 |



3. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
|---|--------------------|--------------------|
| bis einschließlich 300.000 € | 2.790,7 | 2.080,2 |
| mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio € | 117,2 | 30,5 |
| mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio € | 28,3 | 28,2 |
| mehr als 10 Mio € | 373,1 | 419,7 |
| Summe | 3.309,3 | 2.558,6 |

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

| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
|------------------------------------|--------------------|--------------------|
| bis einschließlich 10 Mio € | 67,1 | 87,2 |
| mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio € | 898,5 | 945,1 |
| mehr als 100 Mio € | 2.574,0 | 4.860,7 |
| Summe | 3.539,6 | 5.893,0 |

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

| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
|--------------------|--------------------|--------------------|
| Summe Deutschland | 0,4 | 0,0 |
| Gesamtsumme | 0,4 | 0,0 |

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

| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
|--------------------|--------------------|--------------------|
| Summe Deutschland | 0,0 | 0,2 |
| Gesamtsumme | 0,0 | 0,2 |

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

| | Q II 2019 Mio € | Q II 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 II 2019 Mio € | Q II 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 |

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

| | Q II 2019 | Q II 2018 |
|--|-----------|-----------|
| Zinsstruktur | | |
| Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen | 100,0 % | 100,0 % |
| Anteil festverzinslicher Deckungsmasse | 94,1 % | 95,0 % |
| Weitere Kennzahlen | | |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio € | - | - |
| Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren | 8,6 | 11,2 |
| Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf | 50,3 % | 46,7 % |



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

| | Q II 2019 Mio € | Q II 2018 Mio € |
|---|--------------------|--------------------|
| Deutschland | | |
| Staat | 255,9 | 286,3 |
| Regionale Gebietskörperschaft | 1.789,5 | 3.416,2 |
| Örtliche Gebietskörperschaft | 51,2 | 68,2 |
| Sonstige Schuldner | 1.294,0 | 1.808,3 |
| Summe Deutschland | 3.390,6 | 5.579,0 |
| 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 | 149,0 | 50,0 |
| Summe EU-Institutionen | 149,0 | 50,0 |
| Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung | 0,0 | 0,0 |
| Irland | | |
| Staat | 0,0 | 250,0 |
| Regionale Gebietskörperschaft | 0,0 | 0,0 |
| Örtliche Gebietskörperschaft | 0,0 | 0,0 |
| Sonstige Schuldner | 0,0 | 0,0 |
| Summe Irland | 0,0 | 250,0 |
| 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 | 3.539,6 | 5.893,0 |