



Transparenzreport Register C (DSLBUmwG)

zum 30. September 2020

1. Im Umlauf befindliche Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte:

	Nennwert	Nennwert	Barwert	Barwert	Risikobarwert*	Risikobarwert*
	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Deckungswerte	5.785,3	6.560,2	6.544,4	7.341,4	6.163,1	6.993,4
davon Derivate	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Schuldverschreibungen	5.048,5	5.755,5	5.934,6	6.908,3	5.747,2	6.669,3
Überdeckung in %	14,6	14,0	10,3	6,3	7,2	4,9

* dynamisches Verfahren

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

	Deckungs- werte	Deckungs- werte	Schuldver- schreibungen	Schuldver- schreibungen
	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
bis zu 6 Monate	933,3	1.028,4	456,2	413,0
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	256,2	335,2	1.026,5	294,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	339,9	530,2	720,0	456,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	314,4	402,7	330,0	1.026,5
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	789,8	712,8	360,0	1.050,0
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	213,4	1.206,3	276,5	360,0
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	201,7	211,2	668,3	276,5
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	1.462,0	1.070,8	1.070,0	1.738,3
über 10 Jahre	1.274,6	1.062,6	141,0	141,0
Summe	5.785,3	6.560,2	5.048,5	5.755,5

3. Gesamtbetrag der Ersatzdeckung (Nennwert):

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Summe Bankgeldforderungen	358,2	0,0
Gesamtsumme	358,2	0,0



4. Hypothekendeckungswerte nach Größengruppen (Nennwert):

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
bis einschließlich 300.000 €	2.837,6	2.746,6
mehr als 300.000 € bis einschließlich 1 Mio €	140,3	133,1
mehr als 1 Mio € bis zu 10 Mio €	17,7	27,6
mehr als 10 Mio €	276,0	372,0
Summe	3.271,6	3.279,3

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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
bis einschließlich 10 Mio €	62,4	63,3
mehr als 10 Mio € bis zu 100 Mio €	617,1	957,6
mehr als 100 Mio €	1.476,0	2.260,0
Summe	2.155,5	3.280,9

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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Summe Deutschland	0,4	0,3
Gesamtsumme	0,4	0,3

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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Summe Deutschland	0,5	0,3
Gesamtsumme	0,5	0,3



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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 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 2020 Mio €	Q III 2019 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 III 2020	Q III 2019
Zinsstruktur		
Anteil festverzinslicher Schuldverschreibungen	100,0 %	100,0 %
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	97,5 %	96,6 %
Weitere Kennzahlen		
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio €	-	-
Volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (Seasoning) in Jahren	7,7	8,0
Durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	51,7 %	50,9 %



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

	Q III 2020 Mio €	Q III 2019 Mio €
Deutschland		
Staat	118,4	255,2
Regionale Gebietskörperschaft	1.192,5	1.794,5
Örtliche Gebietskörperschaft	44,2	49,2
Sonstige Schuldner	100,9	1.169,0
Summe Deutschland	1.456,0	3.267,9
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Finnland		
Staat	625,0	0,0
Regionale Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Örtliche Gebietskörperschaft	0,0	0,0
Sonstige Schuldner	0,0	0,0
Summe Finnland	625,0	0,0
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	74,5	13,0
Summe EU-Institutionen	74,5	13,0
Gewährleistet bzw. Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung	0,0	0,0
Gesamtsumme	2.155,5	3.280,9