

DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

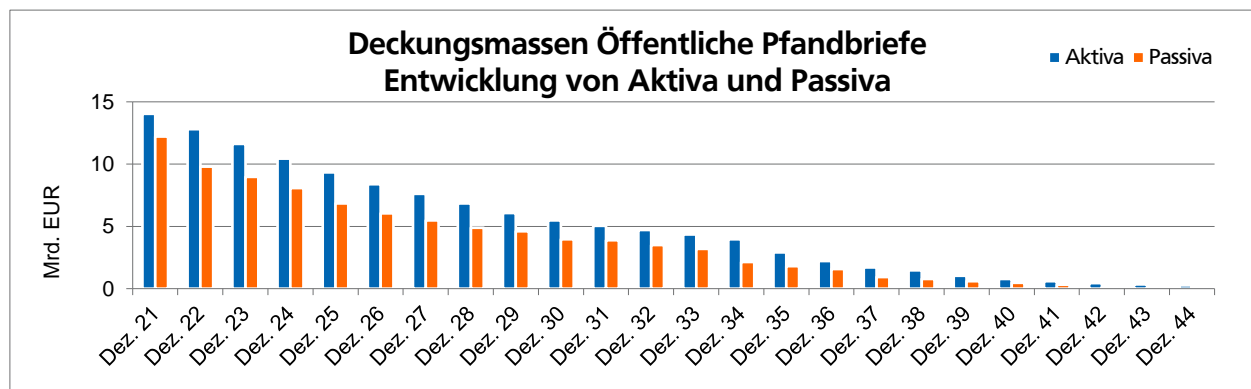
Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:
<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>



Entwicklung der Aktiva, Passiva und der Überdeckung in der Deckungsmasse der öffentlichen Pfandbriefe

31.12.2021

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
31.12.2021	14,03	12,22	1,81
31.12.2022	12,81	9,81	3,00
31.12.2023	11,61	8,99	2,63
31.12.2024	10,44	8,09	2,35
31.12.2025	9,34	6,84	2,50
31.12.2026	8,38	6,05	2,33
31.12.2027	7,61	5,48	2,13
31.12.2028	6,83	4,90	1,93
31.12.2029	6,06	4,61	1,45
31.12.2030	5,47	3,95	1,52
31.12.2031	5,05	3,88	1,17
31.12.2032	4,70	3,50	1,20
31.12.2033	4,35	3,20	1,16
31.12.2034	3,96	2,13	1,82
31.12.2035	2,91	1,81	1,11
31.12.2036	2,22	1,59	0,64
31.12.2037	1,70	0,93	0,77
31.12.2038	1,48	0,77	0,71
31.12.2039	1,03	0,60	0,43
31.12.2040	0,79	0,46	0,33
31.12.2041	0,60	0,31	0,28
31.12.2042	0,44	0,16	0,27
31.12.2043	0,34	0,06	0,28
31.12.2044	0,26	0,06	0,20

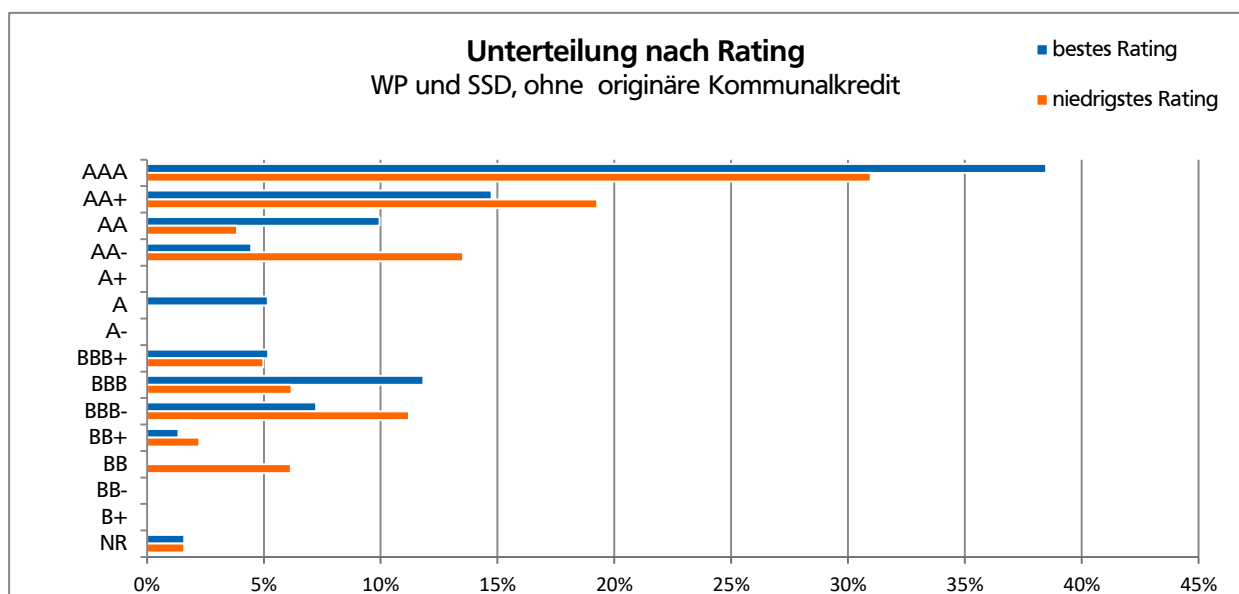


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
31.12.2021

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.747	38%
AA+	669	15%
AA	452	10%
AA-	202	4%
A+	0	0%
A	235	5%
A-	0	0%
BBB+	235	5%
BBB	537	12%
BBB-	328	7%
BB+	62	1%
BB	0	0%
NR*	72	2%
Gesamt	4.539	100%

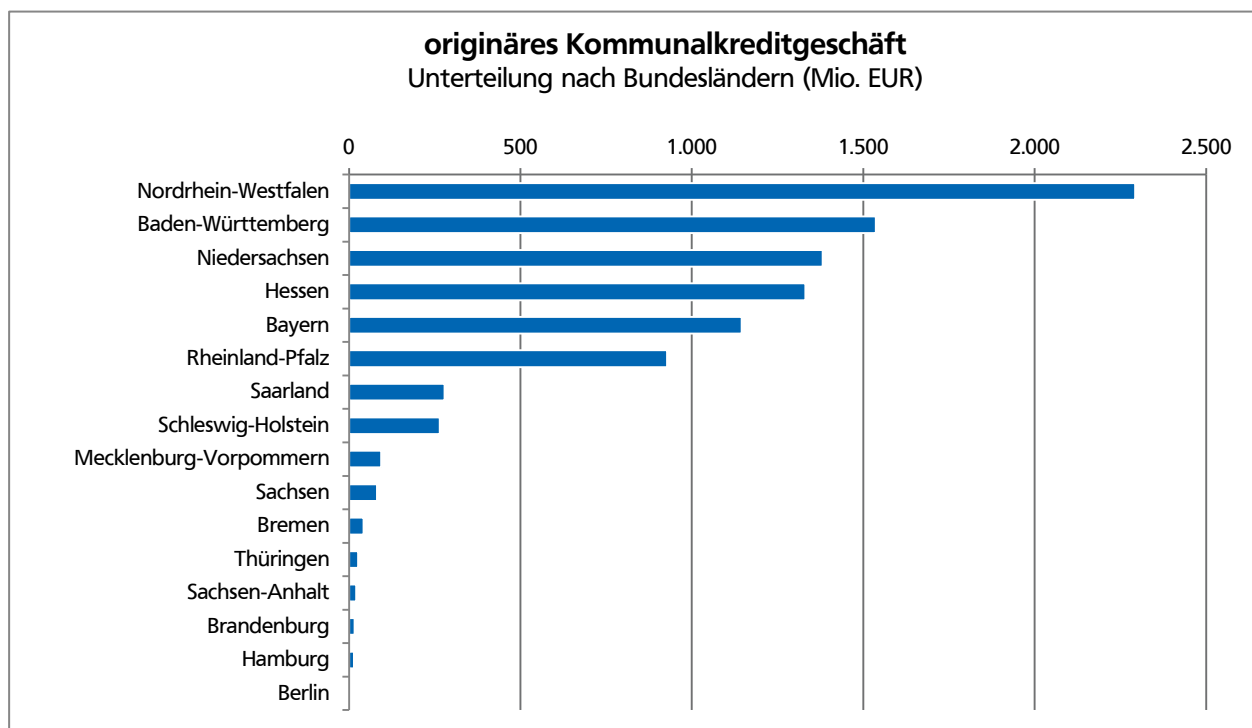
Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
31.12.2021

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.406	31%
AA+	875	19%
AA	175	4%
AA-	614	14%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	0	0%
BBB+	226	5%
BBB	281	6%
BBB-	509	11%
BB+	102	2%
BB	280	6%
NR	72	2%
Gesamt	4.539	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 31.12.2021

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.293	24,24
Baden-Württemberg	1.536	16,24
Niedersachsen	1.381	14,60
Hessen	1.331	14,08
Bayern	1.145	12,11
Rheinland-Pfalz	927	9,81
Saarland	279	2,95
Schleswig-Holstein	264	2,80
Mecklenburg-Vorpommern	93	0,99
Sachsen	81	0,86
Bremen	43	0,45
Thüringen	27	0,29
Sachsen-Anhalt	21	0,22
Brandenburg	17	0,18
Hamburg	14	0,15
Berlin	3	0,03
Gesamt	9.457	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland)		31.12.2021
Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	8.825	75,66
Bundesländer	1.560	13,37
sonstige inländische Kreditnehmer	839	7,19
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	413	3,54
Bund	26	0,22
Summe inländische Kreditnehmer	11.664	100,00

