

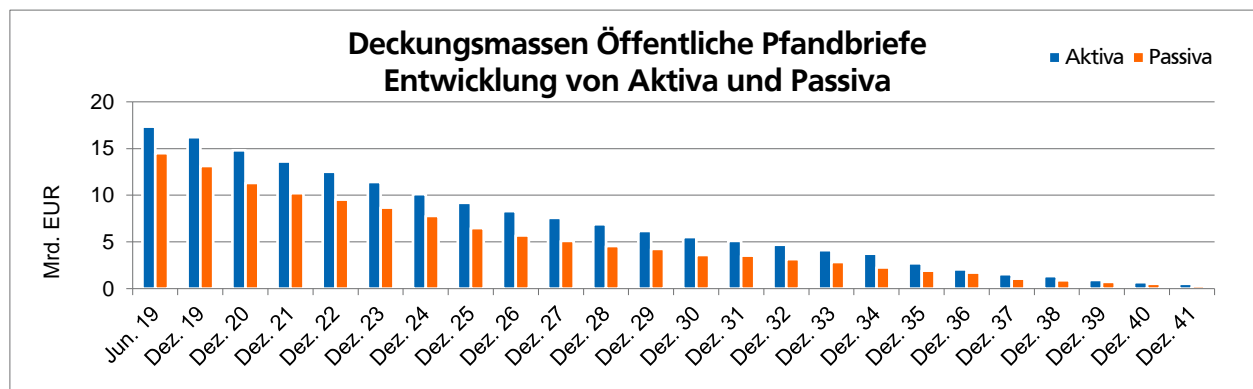
DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

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



Entwicklung der Aktiva, Passiva und der Überdeckung in der Deckungsmasse der öffentlichen Pfandbriefe 30.06.2019

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
30.06.2019	17,34	14,52	2,83
31.12.2019	16,22	13,15	3,07
31.12.2020	14,80	11,31	3,50
31.12.2021	13,60	10,22	3,38
31.12.2022	12,52	9,55	2,96
31.12.2023	11,42	8,68	2,75
31.12.2024	10,12	7,77	2,34
31.12.2025	9,19	6,50	2,69
31.12.2026	8,30	5,70	2,59
31.12.2027	7,59	5,13	2,46
31.12.2028	6,89	4,55	2,33
31.12.2029	6,17	4,26	1,91
31.12.2030	5,54	3,60	1,94
31.12.2031	5,12	3,52	1,59
31.12.2032	4,69	3,16	1,54
31.12.2033	4,11	2,85	1,26
31.12.2034	3,74	2,29	1,45
31.12.2035	2,72	1,94	0,78
31.12.2036	2,05	1,71	0,33
31.12.2037	1,55	1,06	0,48
31.12.2038	1,35	0,90	0,44
31.12.2039	0,92	0,73	0,18
31.12.2040	0,69	0,53	0,16
31.12.2041	0,51	0,31	0,20

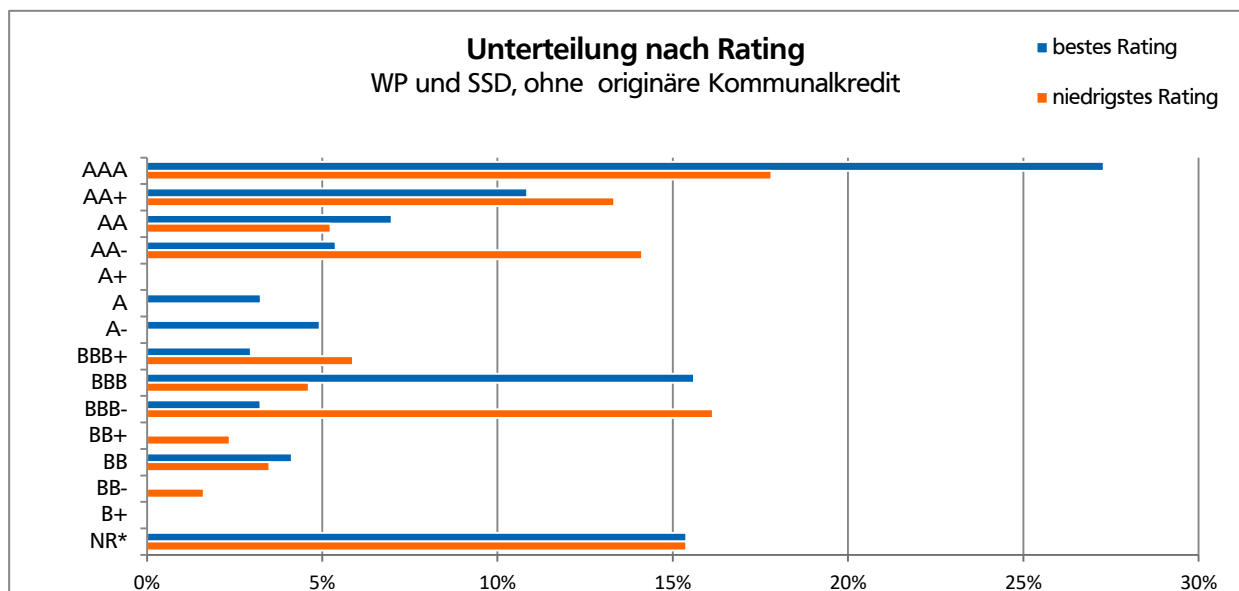


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.06.2019

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.684	27%
AA+	669	11%
AA	430	7%
AA-	332	5%
A+	0	0%
A	200	3%
A-	304	5%
BBB+	183	3%
BBB	962	16%
BBB-	200	3%
BB+	0	0%
BB	255	4%
NR*	949	15%
Gesamt	6.168	100%

Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.06.2019

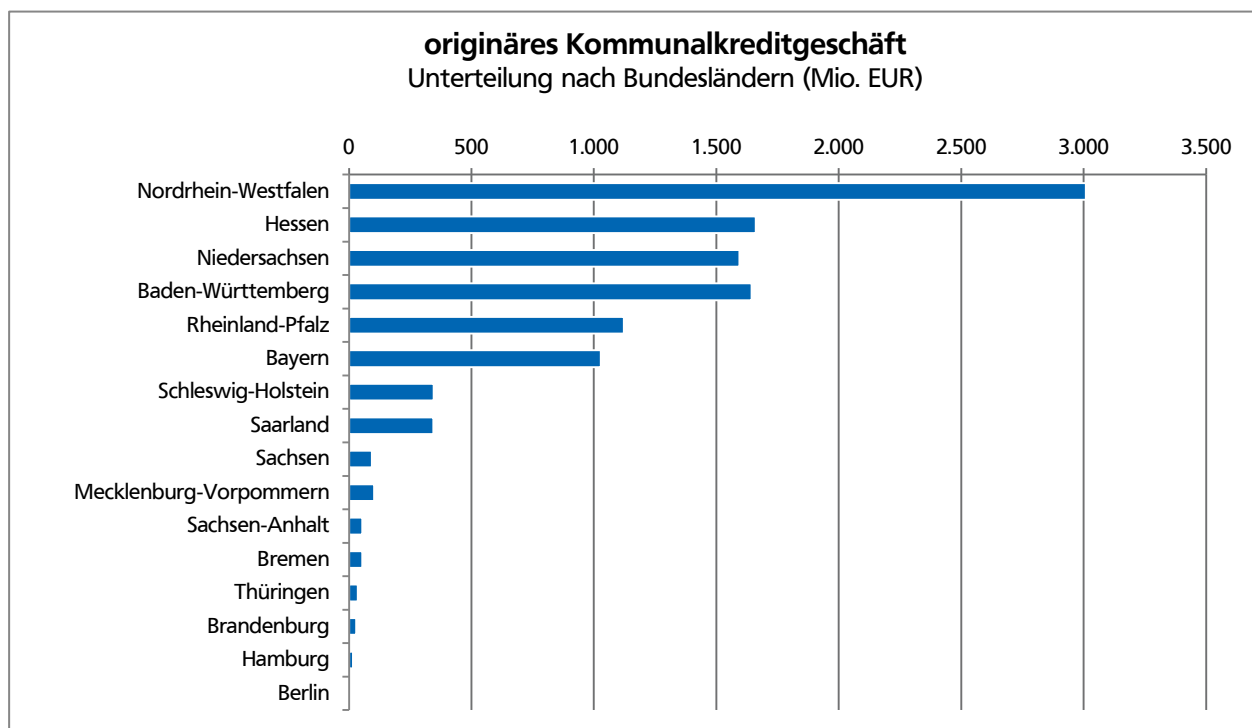
Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.099	18%
AA+	822	13%
AA	323	5%
AA-	871	14%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	0	0%
BBB+	362	6%
BBB	285	5%
BBB-	996	16%
BB+	146	2%
BB	215	3%
BB-	100	2%
B+	0	0%
NR*	949	15%
Gesamt	6.168	100%



* Davon entfallen 301 Mio. EUR auf deutsche Bundesländer, die derzeit über kein Rating verfügen.

Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 30.06.2019

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	3.008	27,02
Hessen	1.660	14,91
Niedersachsen	1.594	14,32
Baden-Württemberg	1.643	14,76
Rheinland-Pfalz	1.122	10,08
Bayern	1.028	9,23
Schleswig-Holstein	345	3,10
Saarland	345	3,10
Sachsen	93	0,84
Mecklenburg-Vorpommern	103	0,92
Sachsen-Anhalt	54	0,49
Bremen	55	0,49
Thüringen	36	0,32
Brandenburg	29	0,26
Hamburg	16	0,14
Berlin	0	0,00
Gesamt	11.132	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland)		30.06.2019
Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	10.464	76,78
Bundesländer	1.661	12,19
sonstige inländische Kreditnehmer	901	6,61
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	578	4,24
Bund	26	0,19
Summe inländische Kreditnehmer	13.629	100,00

