

DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

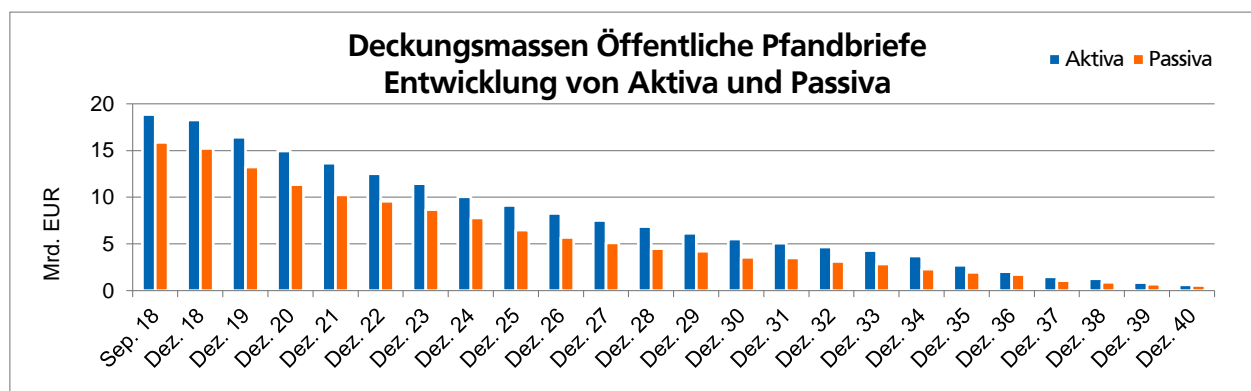
Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:
<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>



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

30.09.2018

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
30.09.2018	18,86	15,89	2,97
31.12.2018	18,26	15,22	3,04
31.12.2019	16,43	13,25	3,18
31.12.2020	14,95	11,35	3,61
31.12.2021	13,64	10,25	3,40
31.12.2022	12,53	9,55	2,98
31.12.2023	11,45	8,68	2,77
31.12.2024	10,05	7,77	2,28
31.12.2025	9,14	6,50	2,64
31.12.2026	8,28	5,70	2,58
31.12.2027	7,53	5,12	2,41
31.12.2028	6,85	4,50	2,34
31.12.2029	6,13	4,24	1,89
31.12.2030	5,51	3,58	1,94
31.12.2031	5,08	3,50	1,58
31.12.2032	4,67	3,14	1,53
31.12.2033	4,30	2,84	1,45
31.12.2034	3,72	2,31	1,41
31.12.2035	2,70	1,95	0,75
31.12.2036	2,04	1,72	0,32
31.12.2037	1,47	1,07	0,40
31.12.2038	1,28	0,91	0,37
31.12.2039	0,86	0,71	0,15
31.12.2040	0,64	0,56	0,08



DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:

<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>

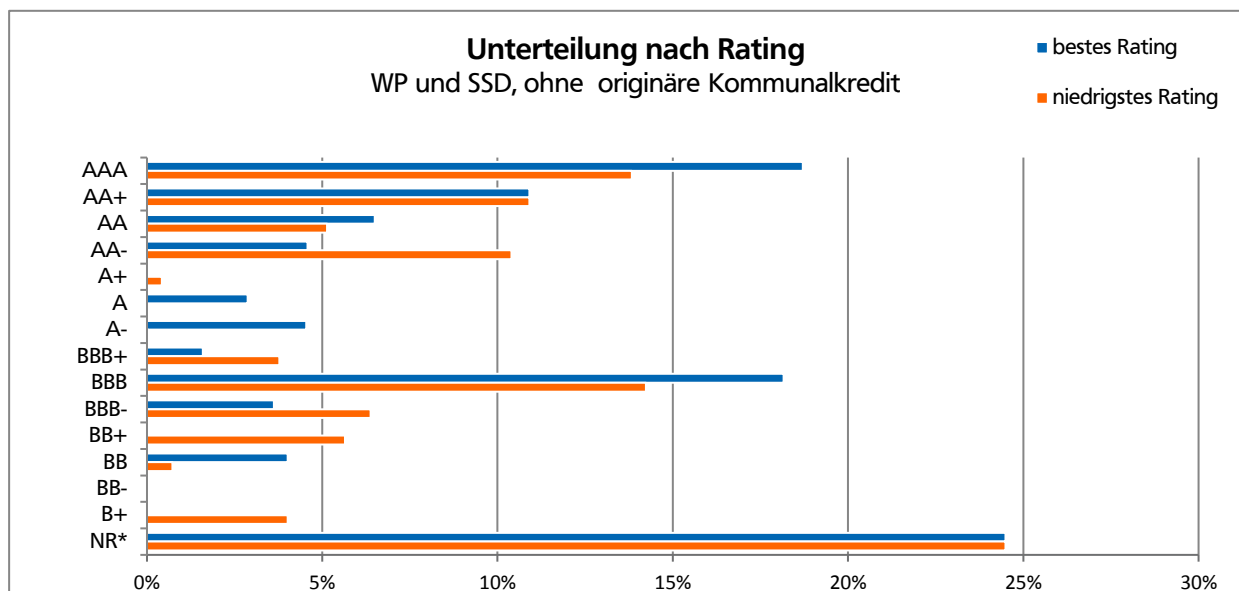


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch 30.09.2018

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.305	19%
AA+	761	11%
AA	453	7%
AA-	319	5%
A+	0	0%
A	200	3%
A-	317	5%
BBB+	111	2%
BBB	1.266	18%
BBB-	253	4%
BB+	0	0%
BB	280	4%
NR*	1.708	24%
Gesamt	6.973	100%

Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch 30.09.2018

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	964	14%
AA+	761	11%
AA	358	5%
AA-	725	10%
A+	30	0%
A	0	0%
A-	2	0%
BBB+	263	4%
BBB	992	14%
BBB-	445	6%
BB+	394	6%
BB	50	1%
BB-	0	0%
B+	280	4%
NR*	1.708	24%
Gesamt	6.973	100%

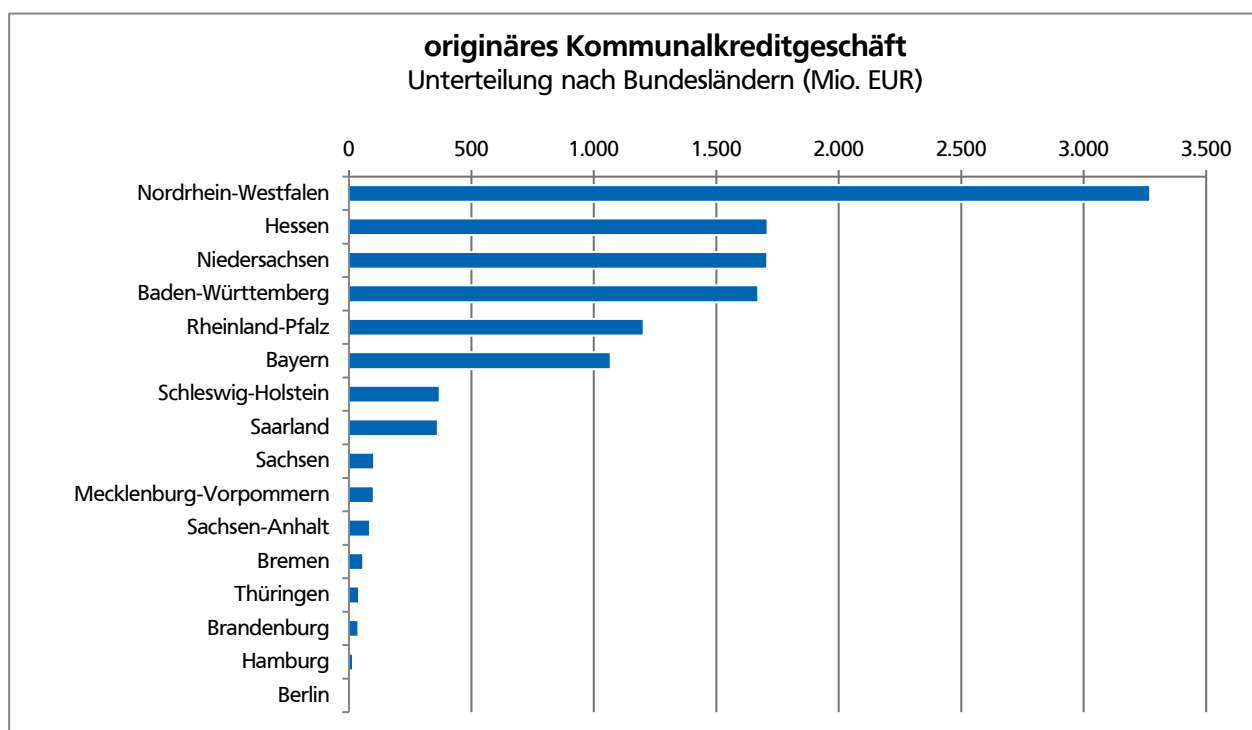


* Davon entfallen 937 Mio. EUR auf deutsche Bundesländer, die derzeit über kein Rating verfügen.

© DZ HYP AG - Rosenstraße 2, 20095 Hamburg - Postfach 10 14 46, 20009 Hamburg

Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 30.09.2018

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	3.271	27,70
Hessen	1.709	14,48
Niedersachsen	1.707	14,46
Baden-Württemberg	1.672	14,15
Rheinland-Pfalz	1.203	10,19
Bayern	1.068	9,05
Schleswig-Holstein	371	3,14
Saarland	363	3,08
Sachsen	102	0,86
Mecklenburg-Vorpommern	101	0,85
Sachsen-Anhalt	86	0,73
Bremen	59	0,50
Thüringen	42	0,35
Brandenburg	38	0,33
Hamburg	16	0,14
Berlin	0	0,00
Gesamt	11.809	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland) 30.09.2018

Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	11.099	75,98
Bundesländer	1.895	12,98
sonstige inländische Kreditnehmer	971	6,65
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	581	3,98
Bund	61	0,42
Summe inländische Kreditnehmer	14.607	100,00

