

DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

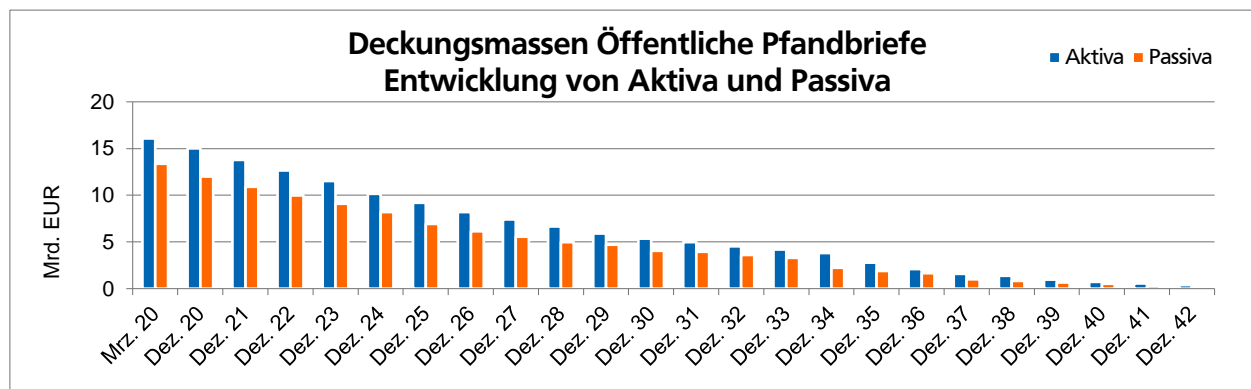
Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:
<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>



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

31.03.2020

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
31.03.2020	16,07	13,38	2,69
31.12.2020	15,01	11,99	3,03
31.12.2021	13,77	10,90	2,88
31.12.2022	12,65	9,98	2,67
31.12.2023	11,52	9,10	2,43
31.12.2024	10,16	8,20	1,96
31.12.2025	9,18	6,94	2,24
31.12.2026	8,19	6,14	2,05
31.12.2027	7,41	5,57	1,84
31.12.2028	6,66	4,99	1,67
31.12.2029	5,89	4,70	1,19
31.12.2030	5,35	4,04	1,31
31.12.2031	4,97	3,96	1,00
31.12.2032	4,54	3,60	0,94
31.12.2033	4,20	3,29	0,91
31.12.2034	3,82	2,23	1,59
31.12.2035	2,79	1,88	0,91
31.12.2036	2,11	1,65	0,46
31.12.2037	1,60	1,00	0,60
31.12.2038	1,39	0,84	0,55
31.12.2039	0,96	0,67	0,28
31.12.2040	0,73	0,53	0,20
31.12.2041	0,54	0,31	0,23
31.12.2042	0,39	0,16	0,22

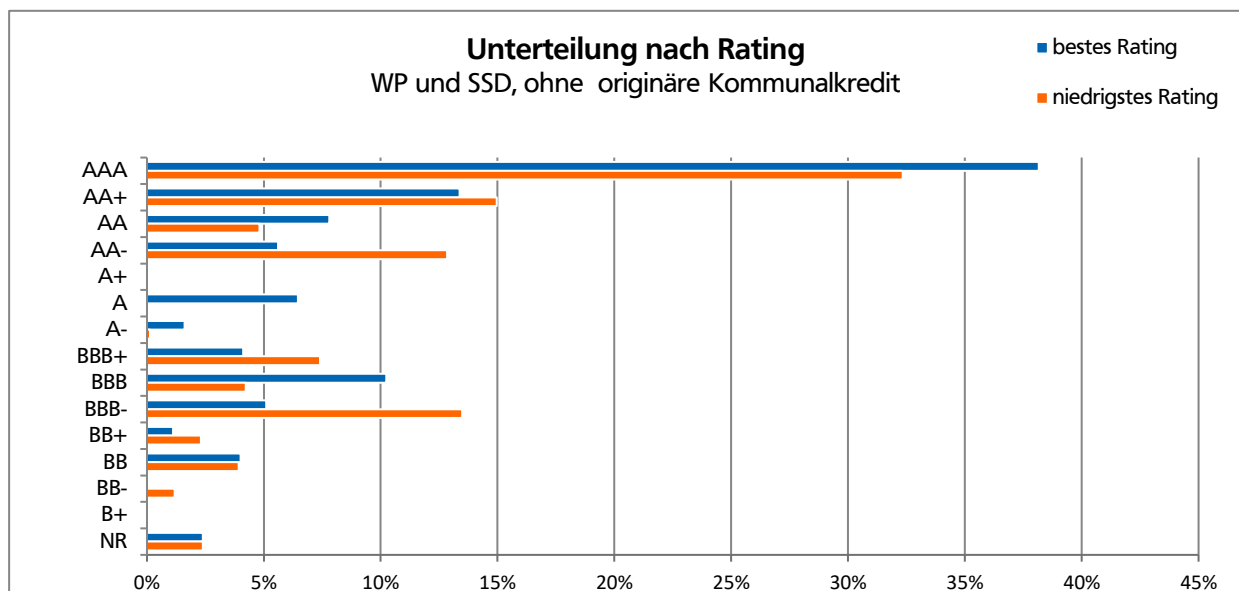


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
31.03.2020

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	2.093	38%
AA+	734	13%
AA	428	8%
AA-	308	6%
A+	0	0%
A	355	6%
A-	88	2%
BBB+	226	4%
BBB	562	10%
BBB-	280	5%
BB+	62	1%
BB	220	4%
NR	131	2%
Gesamt	5.486	100%

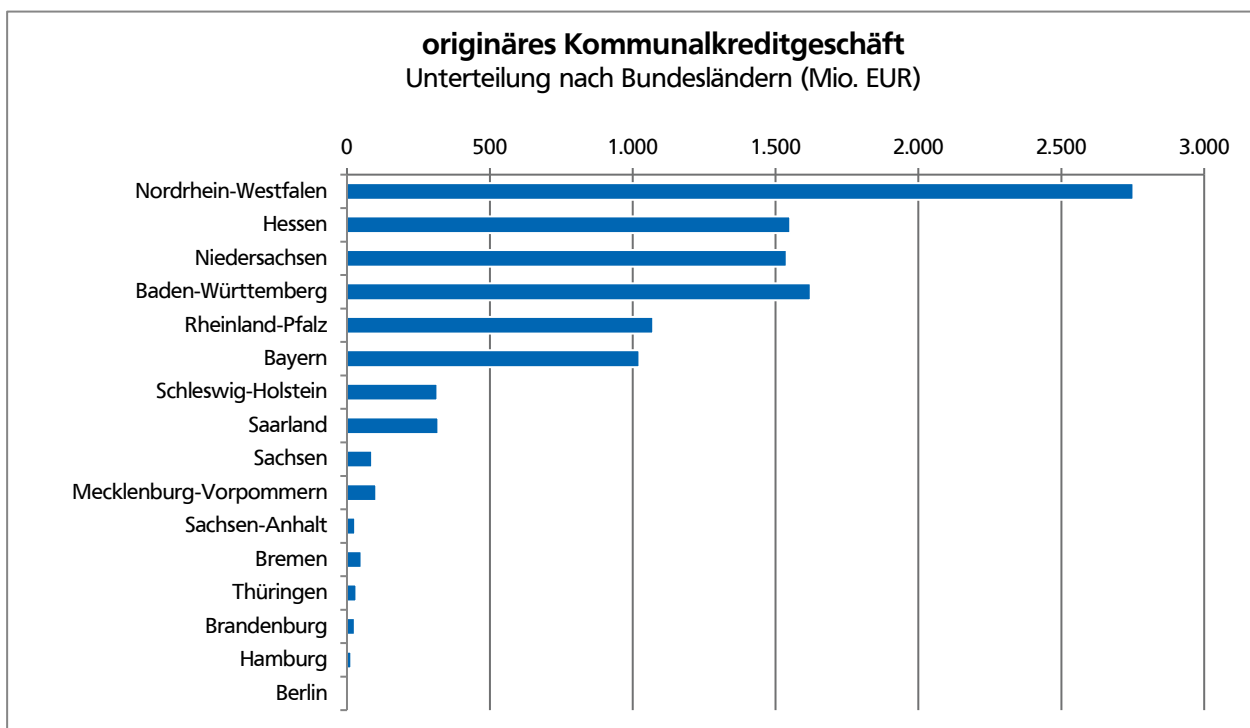
Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
31.03.2020

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.774	32%
AA+	821	15%
AA	264	5%
AA-	704	13%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	7	0%
BBB+	406	7%
BBB	232	4%
BBB-	740	13%
BB+	127	2%
BB	215	4%
BB-	65	1%
B+	0	0%
NR	131	2%
Gesamt	5.486	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 31.03.2020

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.753	26,11
Hessen	1.552	14,72
Niedersachsen	1.539	14,60
Baden-Württemberg	1.623	15,39
Rheinland-Pfalz	1.071	10,16
Bayern	1.024	9,71
Schleswig-Holstein	317	3,00
Saarland	320	3,03
Sachsen	88	0,83
Mecklenburg-Vorpommern	103	0,97
Sachsen-Anhalt	29	0,27
Bremen	51	0,48
Thüringen	33	0,31
Brandenburg	27	0,26
Hamburg	15	0,15
Berlin	0	0,00
Gesamt	10.543	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland)		31.03.2020
Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	9.816	76,24
Bundesländer	1.621	12,59
sonstige inländische Kreditnehmer	1.047	8,13
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	365	2,84
Bund	26	0,20
Summe inländische Kreditnehmer	12.875	100,00

