

DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

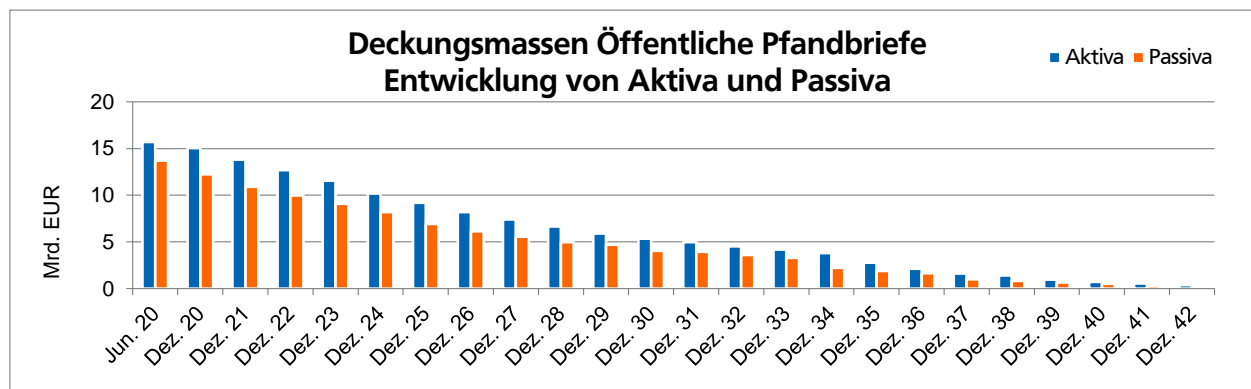
Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:
<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>



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

30.06.2020

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
30.06.2020	15,69	13,73	1,96
31.12.2020	15,05	12,23	2,82
31.12.2021	13,80	10,89	2,91
31.12.2022	12,67	9,97	2,70
31.12.2023	11,55	9,09	2,46
31.12.2024	10,19	8,19	1,99
31.12.2025	9,20	6,94	2,26
31.12.2026	8,22	6,14	2,07
31.12.2027	7,43	5,57	1,86
31.12.2028	6,67	4,99	1,68
31.12.2029	5,91	4,70	1,21
31.12.2030	5,37	4,04	1,32
31.12.2031	4,98	3,97	1,01
31.12.2032	4,55	3,60	0,95
31.12.2033	4,21	3,29	0,92
31.12.2034	3,83	2,23	1,60
31.12.2035	2,80	1,88	0,92
31.12.2036	2,12	1,65	0,46
31.12.2037	1,61	1,00	0,61
31.12.2038	1,40	0,84	0,56
31.12.2039	0,96	0,67	0,29
31.12.2040	0,73	0,53	0,20
31.12.2041	0,55	0,31	0,23
31.12.2042	0,39	0,16	0,23

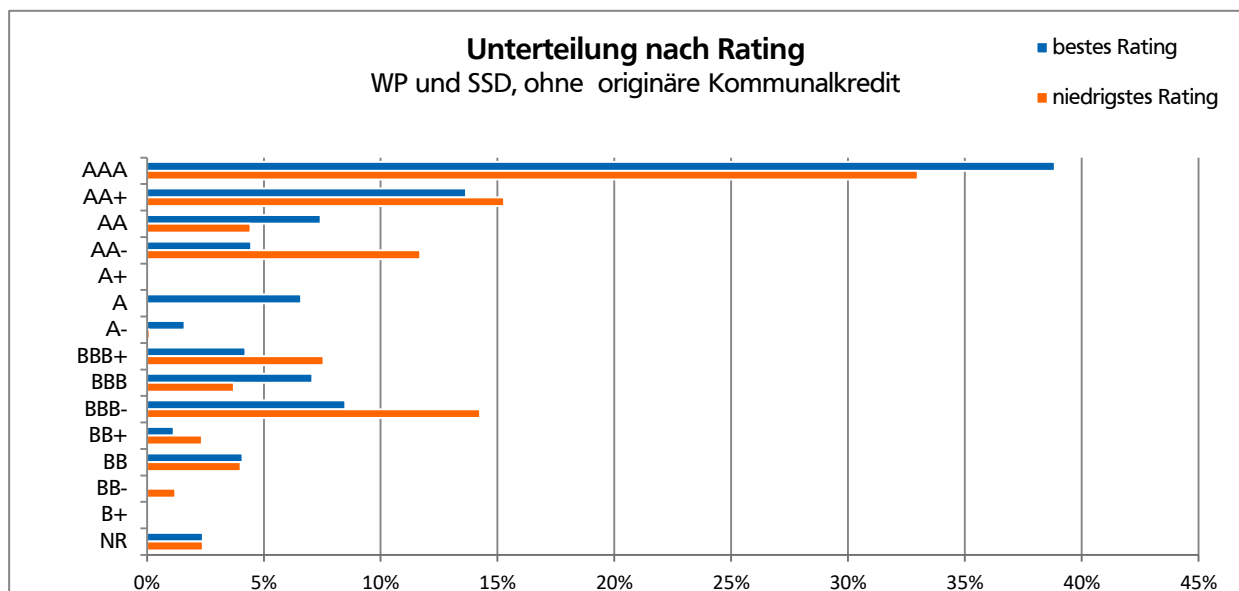


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.06.2020

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	2.087	39%
AA+	734	14%
AA	399	7%
AA-	240	4%
A+	0	0%
A	355	7%
A-	87	2%
BBB+	226	4%
BBB	380	7%
BBB-	456	8%
BB+	62	1%
BB	220	4%
NR	128	2%
Gesamt	5.373	100%

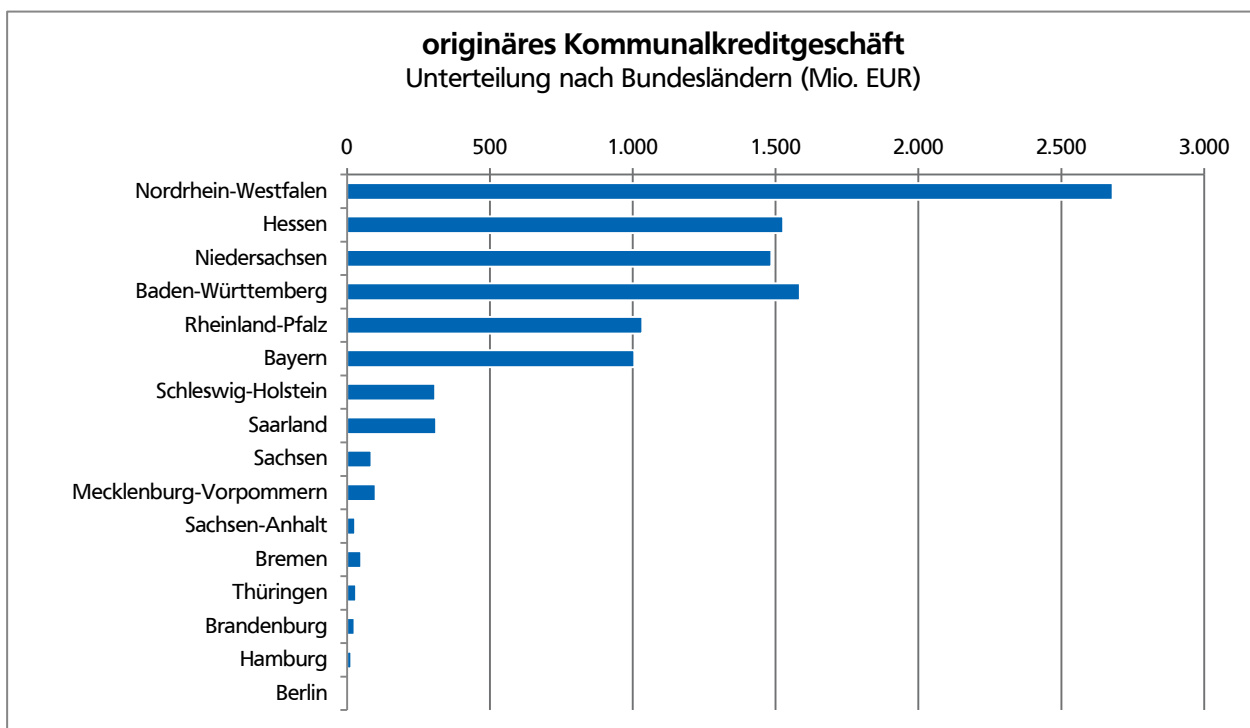
Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.06.2020

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.772	33%
AA+	821	15%
AA	238	4%
AA-	629	12%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	7	0%
BBB+	406	8%
BBB	200	4%
BBB-	766	14%
BB+	127	2%
BB	215	4%
BB-	65	1%
B+	0	0%
NR	128	2%
Gesamt	5.373	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 30.06.2020

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.680	26,08
Hessen	1.527	14,86
Niedersachsen	1.485	14,46
Baden-Württemberg	1.585	15,42
Rheinland-Pfalz	1.034	10,06
Bayern	1.006	9,79
Schleswig-Holstein	308	3,00
Saarland	312	3,04
Sachsen	85	0,83
Mecklenburg-Vorpommern	100	0,98
Sachsen-Anhalt	29	0,28
Bremen	50	0,49
Thüringen	31	0,31
Brandenburg	26	0,25
Hamburg	15	0,15
Berlin	0	0,00
Gesamt	10.275	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland)		30.06.2020
Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	9.584	76,03
Bundesländer	1.619	12,85
sonstige inländische Kreditnehmer	1.022	8,11
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	354	2,81
Bund	26	0,21
Summe inländische Kreditnehmer	12.604	100,00

