

DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

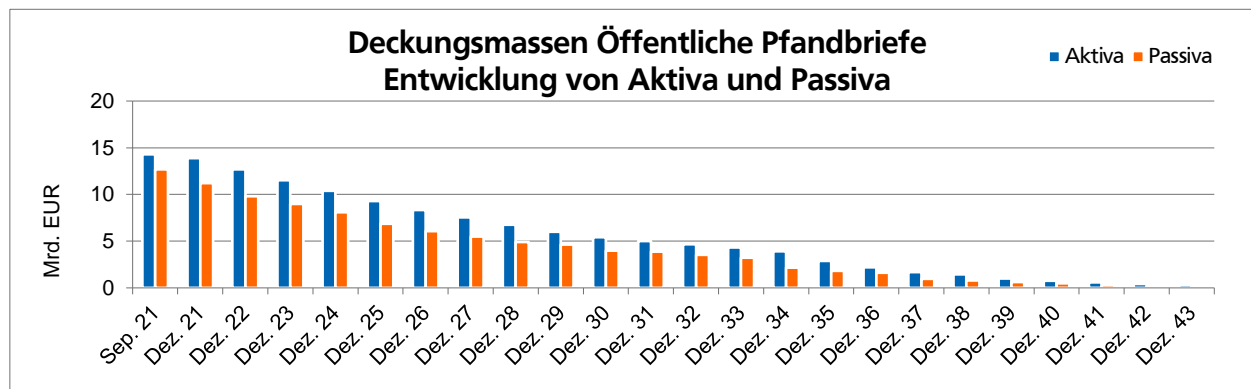
Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:
<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>



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

30.09.2021

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
30.09.2021	14,29	12,68	1,61
31.12.2021	13,89	11,23	2,66
31.12.2022	12,70	9,81	2,89
31.12.2023	11,53	9,00	2,53
31.12.2024	10,37	8,10	2,28
31.12.2025	9,30	6,86	2,43
31.12.2026	8,35	6,07	2,28
31.12.2027	7,53	5,50	2,03
31.12.2028	6,76	4,92	1,84
31.12.2029	6,00	4,63	1,37
31.12.2030	5,41	3,98	1,44
31.12.2031	5,00	3,90	1,11
31.12.2032	4,66	3,52	1,14
31.12.2033	4,31	3,22	1,09
31.12.2034	3,92	2,16	1,76
31.12.2035	2,88	1,83	1,05
31.12.2036	2,19	1,61	0,58
31.12.2037	1,67	0,95	0,72
31.12.2038	1,46	0,80	0,66
31.12.2039	1,01	0,63	0,38
31.12.2040	0,77	0,48	0,29
31.12.2041	0,58	0,31	0,27
31.12.2042	0,42	0,16	0,26
31.12.2043	0,33	0,06	0,27

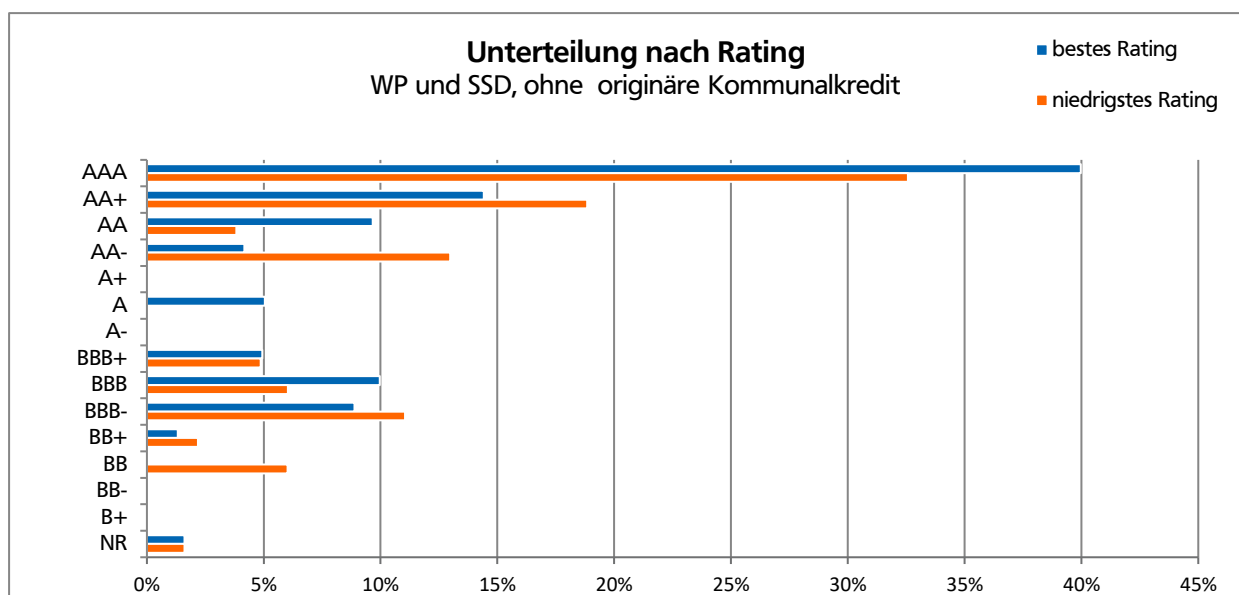


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.09.2021

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.855	40%
AA+	669	14%
AA	448	10%
AA-	194	4%
A+	0	0%
A	235	5%
A-	0	0%
BBB+	229	5%
BBB	462	10%
BBB-	412	9%
BB+	62	1%
BB	0	0%
NR*	75	2%
Gesamt	4.641	100%

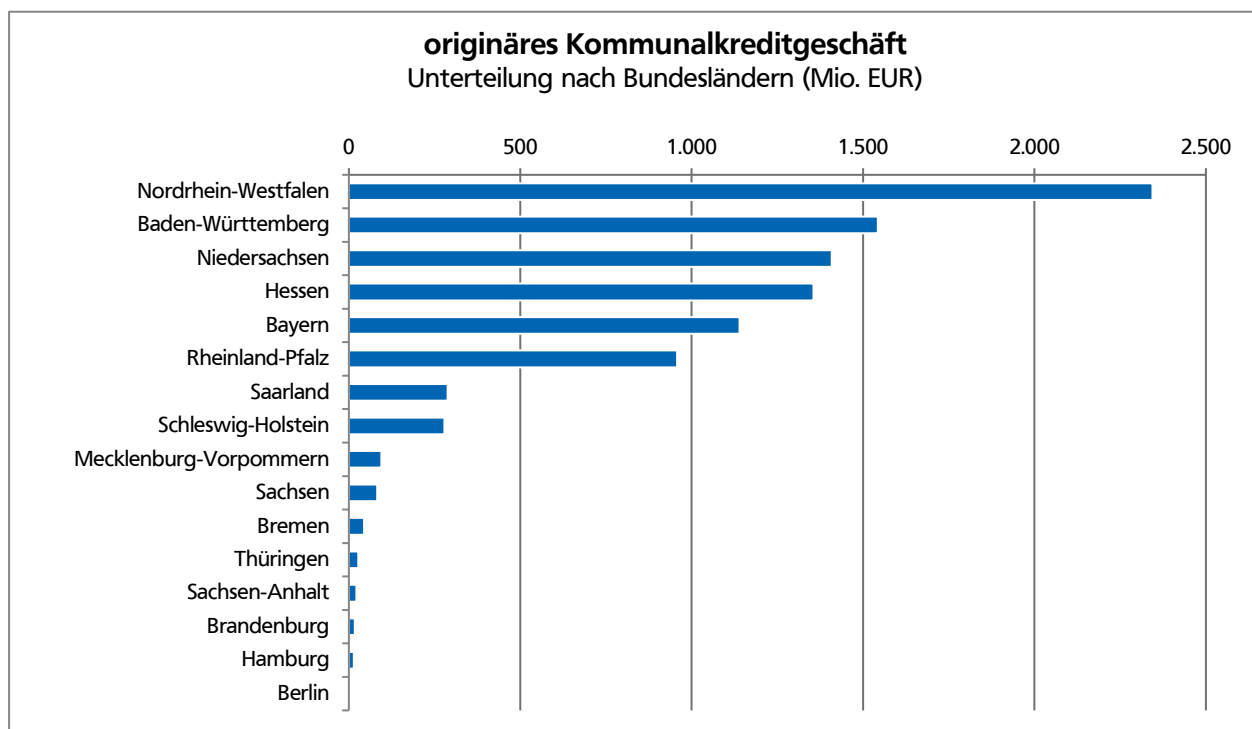
Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.09.2021

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.512	33%
AA+	875	19%
AA	178	4%
AA-	602	13%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	0	0%
BBB+	226	5%
BBB	280	6%
BBB-	513	11%
BB+	102	2%
BB	280	6%
NR	75	2%
Gesamt	4.641	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 30.09.2021

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.345	24,38
Baden-Württemberg	1.543	16,04
Niedersachsen	1.409	14,65
Hessen	1.355	14,09
Bayern	1.139	11,85
Rheinland-Pfalz	958	9,96
Saarland	288	2,99
Schleswig-Holstein	279	2,90
Mecklenburg-Vorpommern	95	0,99
Sachsen	82	0,85
Bremen	44	0,46
Thüringen	28	0,29
Sachsen-Anhalt	22	0,22
Brandenburg	17	0,18
Hamburg	14	0,15
Berlin	0	0,00
Gesamt	9.617	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland) 30.09.2021

Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	8.994	77,11
Bundesländer	1.587	13,60
sonstige inländische Kreditnehmer	659	5,65
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	398	3,42
Bund	26	0,22
Summe inländische Kreditnehmer	11.664	100,00

