

DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

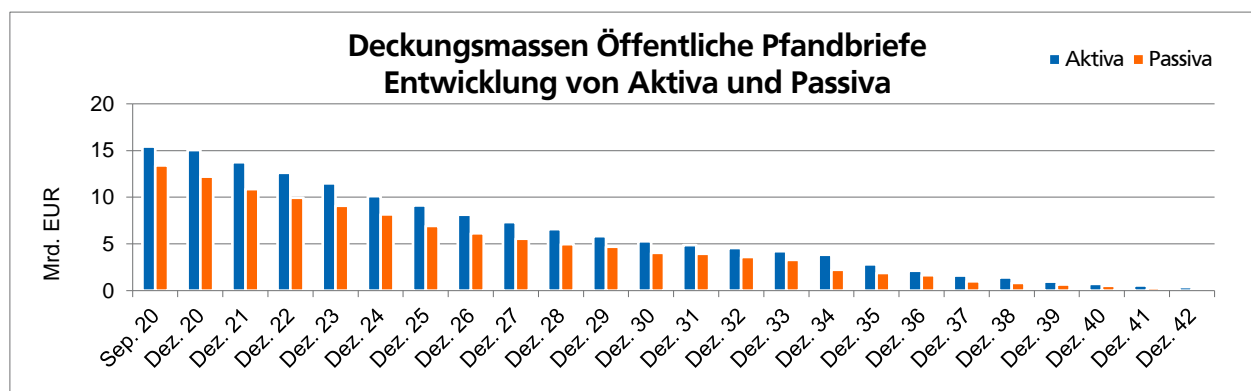
Weitere Daten gemäß PfandBG §28 - Transparenzvorschriften:
<http://www.dzhyp.de/paragraph28/>



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

30.09.2020

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
30.09.2020	15,44	13,42	2,02
31.12.2020	15,04	12,21	2,83
31.12.2021	13,76	10,87	2,89
31.12.2022	12,63	9,95	2,67
31.12.2023	11,49	9,08	2,41
31.12.2024	10,13	8,18	1,95
31.12.2025	9,13	6,94	2,19
31.12.2026	8,15	6,15	2,00
31.12.2027	7,35	5,57	1,78
31.12.2028	6,60	4,99	1,61
31.12.2029	5,83	4,70	1,13
31.12.2030	5,28	4,04	1,23
31.12.2031	4,89	3,97	0,92
31.12.2032	4,56	3,60	0,96
31.12.2033	4,21	3,29	0,92
31.12.2034	3,83	2,23	1,61
31.12.2035	2,80	1,88	0,92
31.12.2036	2,12	1,66	0,47
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

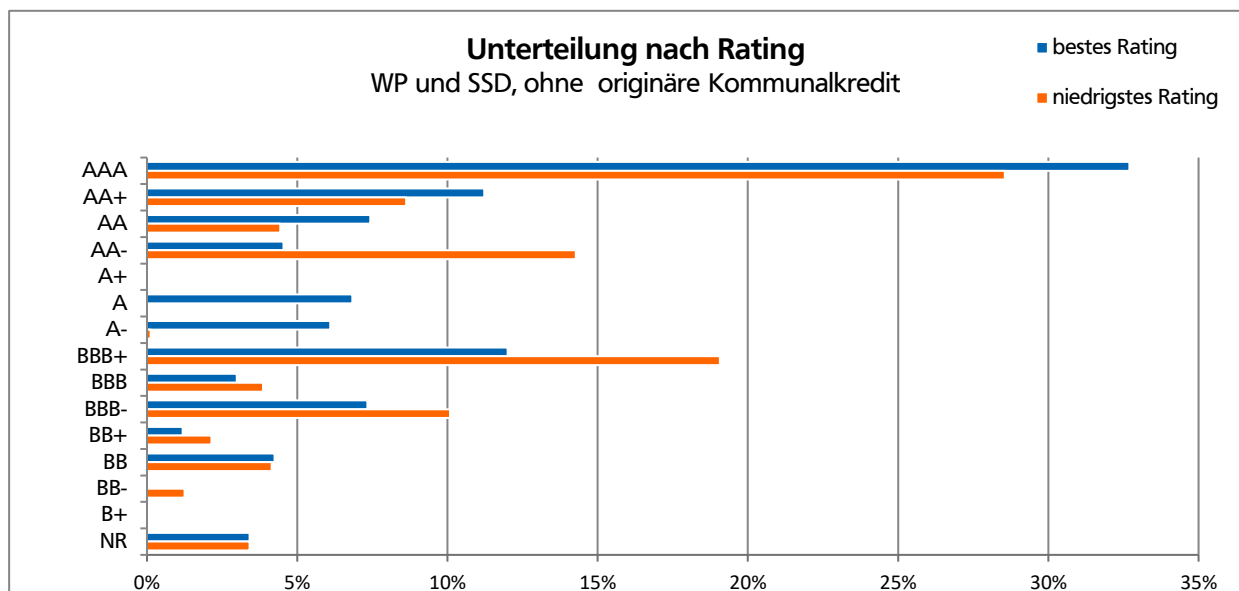


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.09.2020

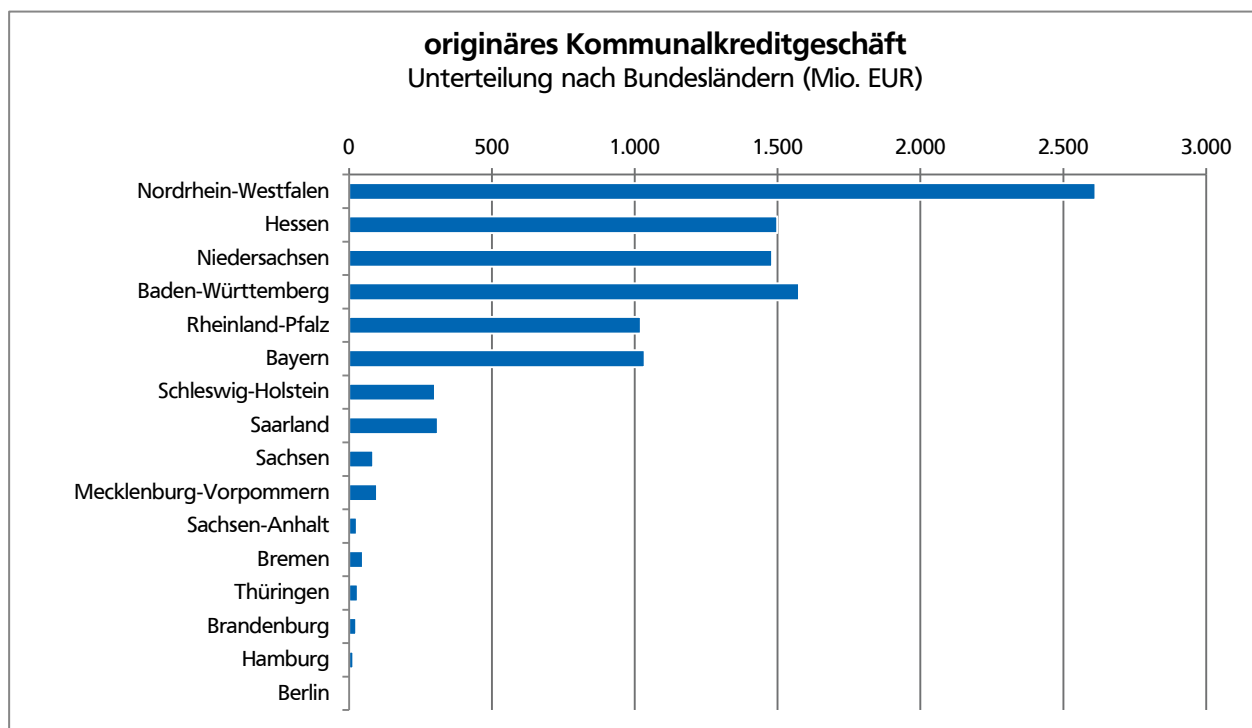
Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.695	33%
AA+	582	11%
AA	385	7%
AA-	236	5%
A+	0	0%
A	355	7%
A-	317	6%
BBB+	623	12%
BBB	155	3%
BBB-	380	7%
BB+	62	1%
BB	220	4%
NR	177	3%
Gesamt	5.185	100%

Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
30.09.2020

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.481	29%
AA+	447	9%
AA	230	4%
AA-	740	14%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	7	0%
BBB+	989	19%
BBB	200	4%
BBB-	523	10%
BB+	112	2%
BB	215	4%
BB-	65	1%
B+	0	0%
NR	177	3%
Gesamt	5.185	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft)		30.09.2020
Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.613	25,71
Hessen	1.498	14,74
Niedersachsen	1.481	14,57
Baden-Württemberg	1.575	15,49
Rheinland-Pfalz	1.021	10,04
Bayern	1.035	10,18
Schleswig-Holstein	300	2,96
Saarland	310	3,05
Sachsen	84	0,83
Mecklenburg-Vorpommern	98	0,97
Sachsen-Anhalt	28	0,27
Bremen	49	0,48
Thüringen	31	0,30
Brandenburg	25	0,25
Hamburg	15	0,15
Berlin	0	0,00
Gesamt	10.163	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland)		30.09.2020
Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	9.475	76,49
Bundesländer	1.617	13,05
sonstige inländische Kreditnehmer	910	7,34
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	360	2,91
Bund	26	0,21
Summe inländische Kreditnehmer	12.387	100,00

