

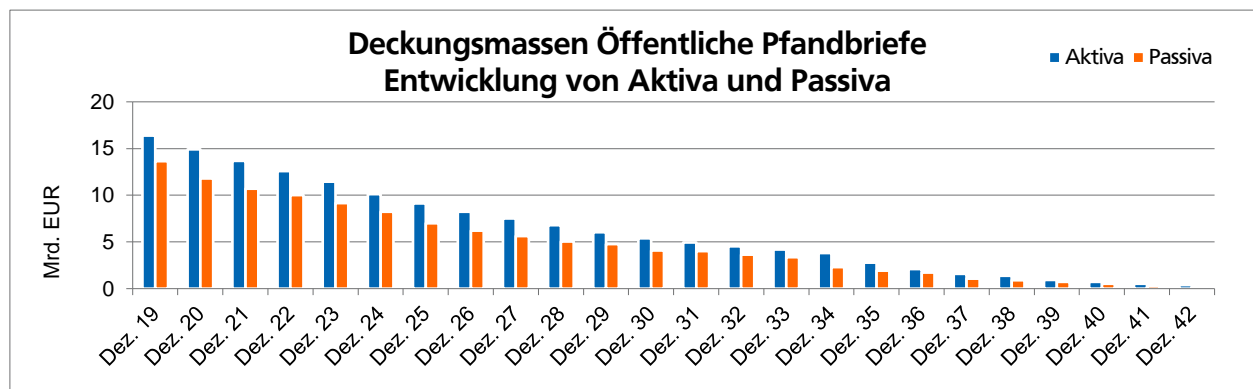
DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

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



Entwicklung der Aktiva, Passiva und der Überdeckung in der Deckungsmasse der öffentlichen Pfandbriefe 31.12.2019

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
31.12.2019	16,40	13,63	2,77
31.12.2020	14,91	11,79	3,13
31.12.2021	13,69	10,70	2,99
31.12.2022	12,57	10,03	2,54
31.12.2023	11,46	9,15	2,31
31.12.2024	10,11	8,25	1,86
31.12.2025	9,14	7,00	2,14
31.12.2026	8,23	6,20	2,02
31.12.2027	7,50	5,63	1,87
31.12.2028	6,78	5,05	1,73
31.12.2029	6,02	4,76	1,26
31.12.2030	5,39	4,10	1,28
31.12.2031	4,95	4,03	0,93
31.12.2032	4,52	3,66	0,86
31.12.2033	4,18	3,35	0,83
31.12.2034	3,80	2,29	1,51
31.12.2035	2,78	1,94	0,83
31.12.2036	2,10	1,72	0,38
31.12.2037	1,59	1,06	0,53
31.12.2038	1,38	0,91	0,48
31.12.2039	0,95	0,74	0,21
31.12.2040	0,72	0,53	0,19
31.12.2041	0,54	0,31	0,23
31.12.2042	0,38	0,16	0,22

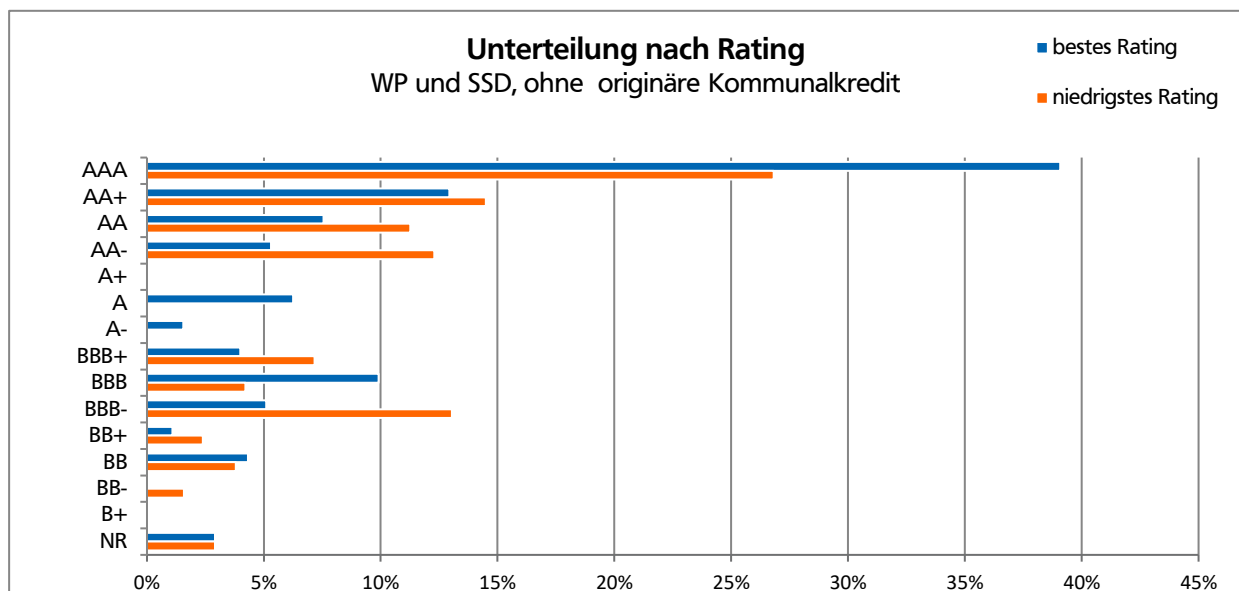


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch
31.12.2019

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	2.215	39%
AA+	734	13%
AA	428	8%
AA-	301	5%
A+	0	0%
A	355	6%
A-	88	2%
BBB+	226	4%
BBB	562	10%
BBB-	289	5%
BB+	62	1%
BB	245	4%
NR	165	3%
Gesamt	5.669	100%

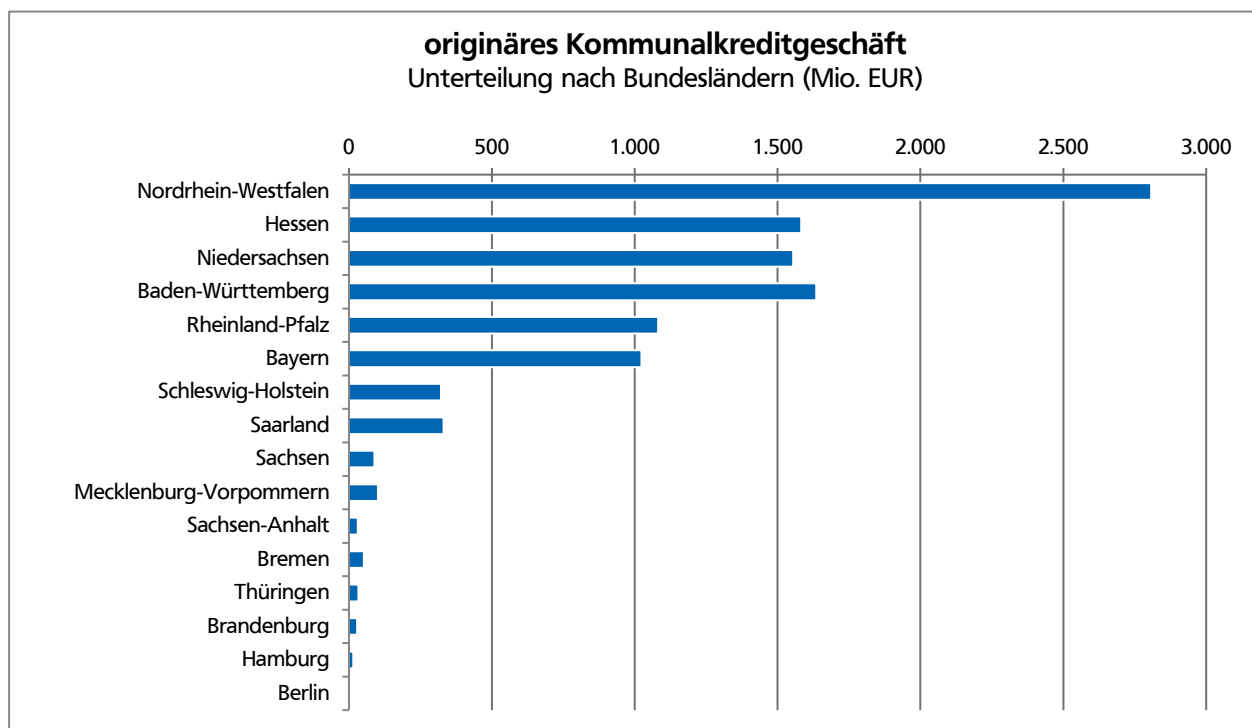
Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch
31.12.2019

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.520	27%
AA+	822	15%
AA	639	11%
AA-	697	12%
A+	0	0%
A	0	0%
A-	0	0%
BBB+	406	7%
BBB	239	4%
BBB-	740	13%
BB+	136	2%
BB	215	4%
BB-	90	2%
B+	0	0%
NR	165	3%
Gesamt	5.669	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 31.12.2019

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.808	26,27
Hessen	1.583	14,81
Niedersachsen	1.554	14,54
Baden-Württemberg	1.635	15,30
Rheinland-Pfalz	1.081	10,12
Bayern	1.023	9,57
Schleswig-Holstein	322	3,02
Saarland	331	3,10
Sachsen	89	0,83
Mecklenburg-Vorpommern	101	0,94
Sachsen-Anhalt	31	0,29
Bremen	52	0,49
Thüringen	34	0,31
Brandenburg	28	0,26
Hamburg	16	0,15
Berlin	0	0,00
Gesamt	10.690	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland)		31.12.2019
Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	9.982	76,66
Bundesländer	1.654	12,70
sonstige inländische Kreditnehmer	866	6,65
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	493	3,79
Bund	26	0,20
Summe inländische Kreditnehmer	13.022	100,00

