

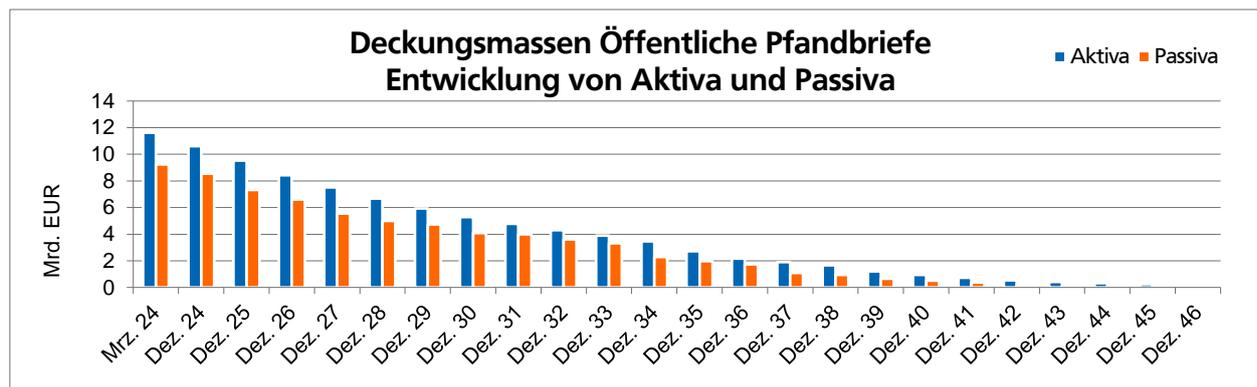
DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

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



Entwicklung der Aktiva, Passiva und der Überdeckung in der Deckungsmasse der öffentlichen Pfandbriefe 31.03.2024

Stichtag	Aktiva Mrd. EUR	Passiva Mrd. EUR	Überdeckung Mrd. EUR
31.03.2024	11,61	9,24	2,36
31.12.2024	10,61	8,54	2,07
31.12.2025	9,53	7,31	2,21
31.12.2026	8,43	6,61	1,82
31.12.2027	7,52	5,54	1,98
31.12.2028	6,68	5,00	1,67
31.12.2029	5,93	4,74	1,19
31.12.2030	5,28	4,07	1,21
31.12.2031	4,79	3,99	0,80
31.12.2032	4,30	3,61	0,69
31.12.2033	3,88	3,31	0,57
31.12.2034	3,46	2,27	1,19
31.12.2035	2,72	1,98	0,74
31.12.2036	2,17	1,74	0,42
31.12.2037	1,91	1,08	0,83
31.12.2038	1,67	0,95	0,72
31.12.2039	1,21	0,65	0,56
31.12.2040	0,94	0,50	0,44
31.12.2041	0,73	0,36	0,37
31.12.2042	0,54	0,21	0,33
31.12.2043	0,42	0,11	0,31
31.12.2044	0,33	0,10	0,23
31.12.2045	0,25	0,10	0,15
31.12.2046	0,19	0,05	0,14



DZ HYP - Öffentlicher Pfandbrief

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

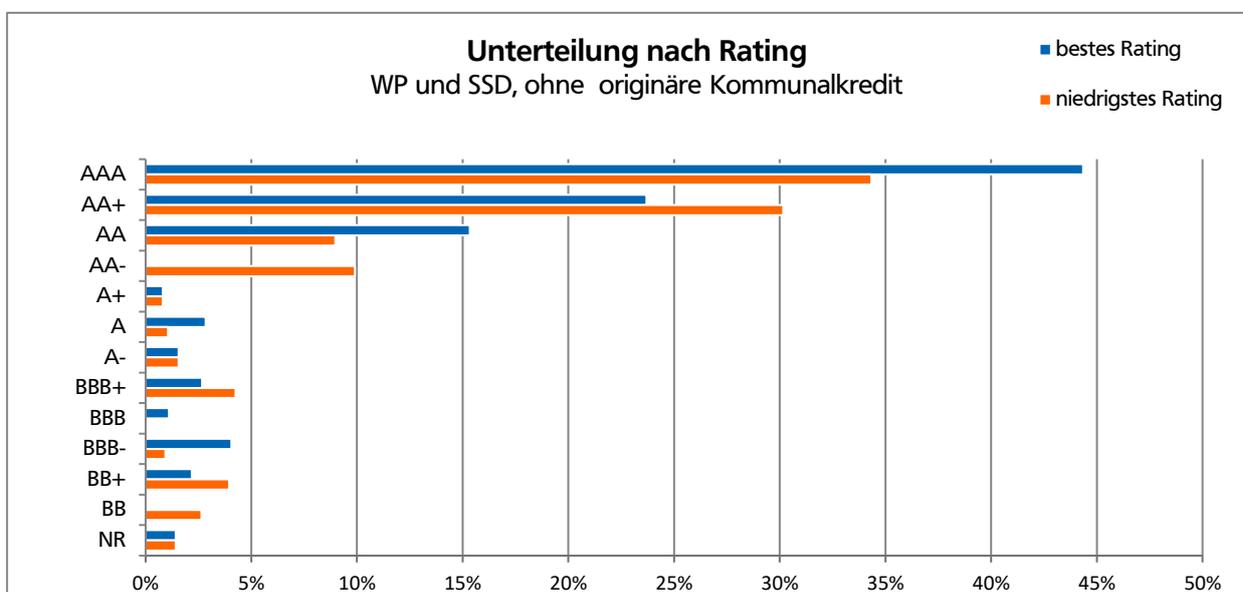


Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils bestem Rating von S&P, Moody's und Fitch 31.03.2024

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	1.253	44%
AA+	669	24%
AA	433	15%
AA-	0	0%
A+	23	1%
A	80	3%
A-	44	2%
BBB+	75	3%
BBB	31	1%
BBB-	115	4%
BB+	62	2%
BB	0	0%
NR*	40	1%
Gesamt	2.825	100%

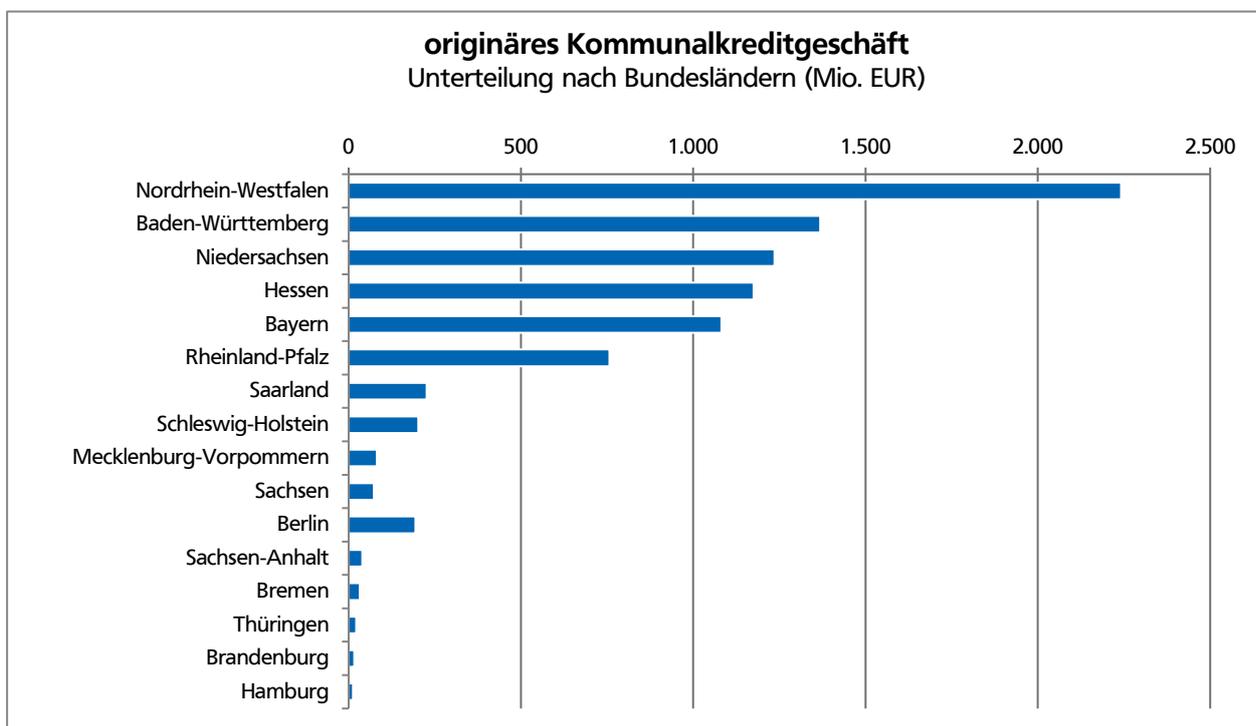
Unterteilung nach Rating (Wertpapiere und Schuldscheine ohne originäre Kommunalkredite) Deckungsmasse nach jeweils niedrigstem Rating von S&P, Moody's und Fitch 31.03.2024

Ratingklassen	Mio. EUR	%
AAA	970	34%
AA+	852	30%
AA	254	9%
AA-	280	10%
A+	23	1%
A	30	1%
A-	44	2%
BBB+	120	4%
BBB	0	0%
BBB-	26	1%
BB+	112	4%
BB	75	3%
NR	40	1%
Gesamt	2.825	100%



Unterteilung nach Bundesländern (originäres Kommunalkreditgeschäft) 31.03.2024

Bundesland	Mio. EUR	%
Nordrhein-Westfalen	2.242	25,59
Baden-Württemberg	1.369	15,63
Niedersachsen	1.236	14,11
Hessen	1.175	13,41
Bayern	1.082	12,35
Rheinland-Pfalz	757	8,64
Saarland	226	2,59
Schleswig-Holstein	202	2,30
Mecklenburg-Vorpommern	82	0,94
Sachsen	73	0,84
Berlin	193	2,21
Sachsen-Anhalt	39	0,45
Bremen	32	0,36
Thüringen	22	0,25
Brandenburg	17	0,19
Hamburg	13	0,14
Gesamt	8.759	100,00



Deckungsmasse Öffentliche Pfandbriefe, Unterteilung nach Kundengruppe (Inland) 31.03.2024

Kundengruppe	Mio. EUR	%
Städte, Gemeinden, Kreise, Bezirke	7.966	77,95
Bundesländer	1.242	12,15
Öffentliche Unternehmen / Zweckverbände	486	4,76
sonstige inländische Kreditnehmer	500	4,89
Bund	26	0,25
Summe inländische Kreditnehmer	10.220	100,00

