



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief

Stichtag 30.09.2023

(Alle Angaben in Mio EUR, soweit nichts anderes angegeben)

1 GESAMTDECKUNGSSTOCK

Im Umlauf befindliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte*

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert - Hochzinsszenario ¹		Risikobarwert - Niedrigzinsszenario ¹		Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen ¹	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
Öffentliche Pfandbriefe	90,0	90,0	93,0	95,3	85,4	70,9	101,9	134,5	85,4	70,9
<i>davon Derivate</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Deckungswerte	142,8	160,5	128,3	139,1	120,2	101,7	137,7	202,8	120,2	101,7
<i>davon Deckungswerte gem. § 20 Abs. 1 PfandBG</i>	125,5	125,5	112,7	112,0	105,8	86,8	120,8	155,6	105,8	86,8
<i>davon Derivate</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	52,8	70,5	35,3	43,8	34,8	30,8	35,8	68,3	34,8	30,8
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	58,7%	78,3%	38,0%	46,0%	40,7%	43,4%	35,1%	50,8%	40,7%	43,4%
<i>Gesetzliche Überdeckung</i>	3,9	4,3	3,5	3,5	3,2	2,6	3,7	4,9	3,2	2,6
<i>nennwertige sichernde Überdeckung</i>	1,8	1,8	1,6	1,6	1,5	1,2	1,7	2,2	1,5	1,2
<i>barwertige sichernde Überdeckung</i>	2,1	2,5	1,9	1,9	1,7	1,4	2,0	2,7	1,7	1,4
<i>Vertragliche Überdeckung</i>	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
<i>Freiwillige Überdeckung</i>	48,9	66,2	31,8	40,3	31,6	28,2	32,1	63,4	31,6	28,2

¹ gemäß § 5 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 PfandBG und § 6 Abs. 2 Nr. 1 PfandBarwertV dynamischer Ansatz

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nrn. 1, 3 PfandBG

Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte*

30.09.2023	<= 6 Monate	>6 Monate und <=12 Monate	>12 Monate und <=18 Monate	>18 Monate und <=2 Jahre	>2 Jahre und <=3 Jahre	>3 Jahre und <=4 Jahre	>4 Jahre und <=5 Jahre	>5 Jahre und <=10 Jahre	> 10 Jahre
Öffentliche Pfandbriefe	0,0	0,0	10,0	0,0	40,0	0,0	0,0	40,0	0,0
Deckungswerte	0,0	0,0	37,0	58,5	0,0	17,3	0,0	30,0	0,0

30.09.2022	<= 6 Monate	>6 Monate und <=12 Monate	>12 Monate und <=18 Monate	>18 Monate und <=2 Jahre	>2 Jahre und <=3 Jahre	>3 Jahre und <=4 Jahre	>4 Jahre und <=5 Jahre	>5 Jahre und <=10 Jahre	> 10 Jahre
Öffentliche Pfandbriefe	0,0	0,0	0,0	0,0	10,0	40,0	0,0	40,0	0,0
Deckungswerte	0,0	0,0	0,0	0,0	95,5	0,0	0,0	65,0	0,0

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 4 PfandBG

Laufzeitenstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe mit Verlängerung von 12 Monaten*

30.09.2023	<= 6 Monate	>6 Monate und <=12 Monate	>12 Monate und <=18 Monate	>18 Monate und <=2 Jahre	>2 Jahre und <=3 Jahre	>3 Jahre und <=4 Jahre	>4 Jahre und <=5 Jahre	>5 Jahre und <=10 Jahre	> 10 Jahre
Pfandbriefe + 12 Monate auf das Fälligkeitsdatum	0,0	0,0	0,0	0,0	10,0	40,0	0,0	40,0	0,0

30.09.2022	<= 6 Monate	>6 Monate und <=12 Monate	>12 Monate und <=18 Monate	>18 Monate und <=2 Jahre	>2 Jahre und <=3 Jahre	>3 Jahre und <=4 Jahre	>4 Jahre und <=5 Jahre	>5 Jahre und <=10 Jahre	> 10 Jahre
Pfandbriefe + 12 Monate auf das Fälligkeitsdatum	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	10,0	40,0	25,0	15,0

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 5 PfandBG

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 der PfandBarwertV*

	Nettobarwert	
	30.09.2023	30.09.2022
	n/a	n/a

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 14 PfandBG



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief

Stichtag 30.09.2023

(Alle Angaben in Mio EUR, soweit nichts anderes angegeben)

Zinsstruktur*

	Nennwert	
	30.09.2023	30.09.2022
Festverzinsliche Öffentliche Pfandbriefe	90,0	90,0
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	142,8	123,5
<i>als % der Deckungsmasse</i>	100,00%	76,95%

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 13 PfandBG

2 STRUKTUR DES DECKUNGSSTOCKES

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen nach Größengruppen (Nennwert)*

	Nennwert	
	30.09.2023	30.09.2022
bis einschließlich 10 Mio EUR	0,0	0,0
mehr als 10 Mio EUR bis zu 100 Mio EUR	125,5	88,5
mehr als 100 Mio EUR	0,0	0,0
	125,5	88,5

* gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

Verteilung der verwendeten Forderungen nach Staaten und Schuldnerklassen*

	davon geschuldet von					davon gewährleistet von					Nennwert gesamt	
	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe	Summe gesamt	als % der Deckungswerte
Deutschland	0,0	37,0	0,0	0,0	37,0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	37,0	25,91%
Niederlande	88,5	0,0	0,0	0,0	88,5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	88,5	61,99%
Summe	88,5	37,0	0,0	0,0	125,5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	125,5	87,90%
als % der Deckungswerte	61,99%	25,91%	0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%	0,00%			

* gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

Weitere Deckungswerte

	Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 2 PfandBG ¹				Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 3a bis 3c PfandBG ²				Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 4 PfandBG ³			
	Insgesamt		davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)		Insgesamt		davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)		Insgesamt		davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Summe	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<i>davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 2³</i>	0,0	0,0			0,0	0,0			0,0	0,0		
<i>davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 3⁴</i>	0,0	0,0			0,0	0,0			0,0	0,0		

¹ gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 8 PfandBG

² gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 9 PfandBG

³ gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12 PfandBG

⁴ gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 11 PfandBG

Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief

Stichtag 30.09.2023

(Alle Angaben in Mio EUR, soweit nichts anderes angegeben)

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
	Größte Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	0,0	0,0	0,00%
<i>davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 2</i>	0,0	0,0	0,00%	0,00%

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
	Größte Geldforderung gegen Bundesbank*	0,0	0,0	0,00%
<i>davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 2</i>	0,0	0,0	0,00%	0,00%

* gemäß § 20 Abs. 2 Satz 1 PfandBG

3 WEITERE KENNZAHLEN

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen und deren Verteilung nach Staaten und Schuldnerklassen*

	Nennwert		davon Forderungen mit mindestens 5% Rückstand	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
	Deutschland	0,0	0,0	0,0
Niederlande	0,0	0,0	0,0	0,0
	0,0	0,0	0,0	0,0

* gemäß § 28 Abs. 3 Satz 3 Nr. 3 PfandBG

Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 6 PfandBG

	30.09.2023	30.09.2022
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	-1.959.000,00	-1.958.500,00
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	11.03.2024	10.03.2023
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	17.275.000,00	35.000.000,00



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief

Stichtag 30.09.2023

(Alle Angaben in Mio EUR, soweit nichts anderes angegeben)

Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 7 PfandBG

	30.09.2023	30.09.2022
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs.2 Satz 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	0,00%	0,00%
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs.2 Satz 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	0,00%	0,00%
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs.2 Satz 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	0,00%	0,00%
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs.2 Satz 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	0,00%	0,00%
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs.2 Satz 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	0,00%	0,00%
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs.2 Satz 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	0,00%	0,00%

Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 15 PfandBG

	30.09.2023	30.09.2022
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	0,00%	0,00%

Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung*

Inhaber-Pfandbriefe				
#	30.09.2023		30.09.2022	
	ISIN	Nennwert	ISIN	Nennwert
1	n/a	n/a	n/a	n/a

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 PfandBG

Namenspfandbriefe				
#	30.09.2023		30.09.2022	
	Identifikationsnummer	Nennwert	Identifikationsnummer	Nennwert
1	3812601	20,0	3812601	20,0
2	3812602	20,0	3812602	20,0
3	3812603	10,0	3812603	10,0
4	3812604	25,0	3812604	25,0
5	3812606	15,0	3812606	15,0



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief

Stichtag 30.09.2023

(Alle Angaben in Mio EUR, soweit nichts anderes angegeben)

* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 PfandBG