



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

Stichtag 31.12.2023

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

**1 GESAMTDECKUNGSSTOCK**

**Im Umlauf befindliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte\***

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert - Hochzinsszenario <sup>1</sup>		Risikobarwert - Niedrigzinsszenario <sup>1</sup>		Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen <sup>1</sup>	
	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022
	<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0	95,8	93,5	91,0	73,5	101,1	124,4	101,1
<i>davon Derivate</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Deckungswerte</b>	119,0	142,8	112,3	125,1	109,0	102,5	115,8	159,6	115,8	102,5
<i>davon Deckungswerte gem. § 20 Abs. 1 PfandBG</i>	110,5	125,5	104,2	111,6	101,3	93,6	107,4	138,3	107,4	93,6
<i>davon Derivate</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Überdeckung</b>	29,0	52,8	16,5	31,6	18,0	29,0	14,7	35,2	14,7	29,0
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	32,22%	58,64%	17,16%	33,79%	19,77%	39,52%	14,56%	28,30%	14,56%	39,52%
<i>Gesetzliche Überdeckung</i>	3,9	4,2	3,7	3,5	3,5	2,8	3,7	4,5	3,7	2,8
<i>nennwertige sichernde Überdeckung</i>	1,8	1,8	1,7	1,6	1,7	1,3	1,7	2,0	1,7	1,3
<i>barwertige sichernde Überdeckung</i>	2,1	2,4	2,0	1,9	1,8	1,5	2,0	2,5	2,0	1,5
<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>	25,1	48,6	12,8	28,1	14,5	26,2	11,0	30,7	11,0	26,2

<sup>1</sup> 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\***

31.12.2023	<= 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
<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	0,0	0,0	10,0	40,0	0,0	0,0	0,0	40,0	0,0
<b>Deckungswerte</b>	0,0	37,0	0,0	58,5	0,0	8,5	0,0	15,0	0,0

31.12.2022	<= 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
<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	50,0	0,0	0,0	40,0	0,0
<b>Deckungswerte</b>	0,0	0,0	0,0	37,0	58,5	0,0	1,3	46,0	0,0

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

**Laufzeitenstruktur der Öffentlichen Pfandbriefe mit Verlängerung von 12 Monaten\***

31.12.2023	<= 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
<b>Pfandbriefe + 12 Monate auf das Fälligkeitsdatum</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	50,0	0,0	0,0	40,0	0,0

31.12.2022	<= 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
<b>Pfandbriefe + 12 Monate auf das Fälligkeitsdatum</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	50,0	0,0	25,0	15,0

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

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

	Nettobarwert	
	31.12.2023	31.12.2022
	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 31.12.2023

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

### Zinsstruktur\*

	Nennwert	
	31.12.2023	31.12.2022
<b>Festverzinsliche Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	100,00%	100,00%
<b>Festverzinsliche Deckungswerte</b>	119,0	142,8
<i>als % der Deckungsmasse</i>	100,00%	100,00%

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

### 2 STRUKTUR DES DECKUNGSSTOCKES

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

	Nennwert	
	31.12.2023	31.12.2022
<b>bis einschließlich 10 Mio EUR</b>	0,0	0,0
<b>mehr als 10 Mio EUR bis zu 100 Mio EUR</b>	110,5	125,5
<b>mehr als 100 Mio EUR</b>	0,0	0,0
	<b>110,5</b>	<b>125,5</b>

\* 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
<b>Deutschland</b>	0,0	37,0	0,0	0,0	37,0	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	37,0	31,09%
<b>Niederlande</b>	73,5	0,0	0,0	0,0	73,5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	73,5	61,76%
<b>Summe</b>	73,5	37,0	0,0	0,0	110,5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	110,5	92,86%
<b>als % der Deckungswerte</b>	61,76%	31,09%	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 <sup>1</sup>				Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 3a bis 3c PfandBG <sup>2</sup>				Forderungen gem. § 20 Abs. 2 Satz 1 Nr. 4 PfandBG <sup>3</sup>			
	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)	
	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022
<b>Deutschland</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Summe</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
<i>davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 2<sup>3</sup></i>	0,0	0,0			0,0	0,0			0,0	0,0		
<i>davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 3<sup>4</sup></i>	0,0	0,0			0,0	0,0			0,0	0,0		

<sup>1</sup> gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 8 PfandBG

<sup>2</sup> gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 9 PfandBG

<sup>3</sup> gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 12 PfandBG

<sup>4</sup> gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 11 PfandBG



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

Stichtag 31.12.2023

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

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022
	<b>Größte Geldforderung gegen ein Kreditinstitut</b>	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	
	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022
	<b>Größte Geldforderung gegen Bundesbank*</b>	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	
	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022
	<b>Deutschland</b>	0,0	0,0	0,0
<b>Niederlande</b>	0,0	0,0	0,0	0,0
	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>

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

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

	31.12.2023	31.12.2022
<b>Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)</b>	-1.950.750,00	-1.950.750,00
<b>Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt</b>	12.04.2024	12.04.2023
<b>Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)</b>	8.500.000,00	17.275.000,00



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

Stichtag 31.12.2023

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

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

	31.12.2023	31.12.2022
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

	31.12.2023	31.12.2022
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				
#	31.12.2023		31.12.2022	
	ISIN	Nennwert	ISIN	Nennwert
1	n/a	n/a	n/a	n/a

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

Namenspfandbriefe				
#	31.12.2023		31.12.2022	
	Identifikationsnummer	Nennwert	Identifikationsnummer	Nennwert
1	3812601	20,0	3812602	20,0
2	3812602	20,0	3812601	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 31.12.2023

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

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