



Stichtag 31.03.2023

(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>	
	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022
<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0	94,7	106,7	82,2	101,1	110,6	112,7	82,2	112,7
<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>	142,8	126,0	126,9	125,3	111,7	121,6	146,3	129,2	111,7	129,2
<i>davon Deckungswerte gem. § 20 Abs. 1 PfandBG</i>	125,5	120,5	113,0	119,1	100,4	116,1	128,9	122,1	100,4	122,1
<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>Überdeckung</b>	52,8	36,0	32,2	18,6	29,5	20,5	35,7	16,5	29,5	16,5
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	58,7%	40,0%	34,0%	17,4%	35,9%	20,3%	32,3%	14,6%	35,9%	14,6%
<i>Gesetzliche Überdeckung</i>	4,2	3,8	3,5	4,1	3,0	3,7	4,0	4,1	3,0	4,1
<i>nennwertige sichernde Überdeckung</i>	1,8	1,8	1,6	1,8	1,4	1,7	1,8	1,8	1,4	1,8
<i>barwertige sichernde Überdeckung</i>	2,4	2,0	1,9	2,3	1,6	2,0	2,2	2,3	1,6	2,3
<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>	48,6	32,2	28,7	14,5	26,5	16,8	31,7	12,4	26,5	12,4

<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\*

31.03.2023	<= 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	0,0	10,0	40,0	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

31.03.2022	<= 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	10,0	40,0	0,0	25,0	15,0
<b>Deckungswerte</b>	25,0	0,0	0,0	0,0	37,0	58,5	0,0	0,0	5,5

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

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

31.03.2023	<= 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	10,0	40,0	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	
	31.03.2023	31.03.2022
	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 31.03.2023

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

### Zinsstruktur\*

	Nennwert	
	31.03.2023	31.03.2022
<b>Festverzinsliche Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	100,00%	100,00%
<b>Festverzinsliche Deckungswerte</b>	142,8	126,0
<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	
	31.03.2023	31.03.2022
<b>bis einschließlich 10 Mio EUR</b>	0,0	0,0
<b>mehr als 10 Mio EUR bis zu 100 Mio EUR</b>	125,5	120,5
<b>mehr als 100 Mio EUR</b>	0,0	0,0
	<b>125,5</b>	<b>120,5</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	25,91%
<b>Niederlande</b>	88,5	0,0	0,0	0,0	88,5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	88,5	61,99%
<b>Summe</b>	88,5	37,0	0,0	0,0	125,5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,0	125,5	87,90%
<b>als % der Deckungswerte</b>	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 <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 Schuldverschreibung)		Insgesamt		davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibung)		Insgesamt		davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibung)	
	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022
<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 31.03.2023

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

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022
Größte Geldforderung gegen ein Kreditinstitut	0,0	0,0	0,00%	0,00%
davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 2	0,0	0,0	0,00%	0,00%

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022
Größte Geldforderung gegen Bundesbank*	0,0	0,0	0,00%	0,00%
davon Grenzüberschr. nach § 20 Abs. 2	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	
	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022
Deutschland	0,0	0,0	0,0	0,0
Niederlande	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

	31.03.2023	31.03.2022
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	-1.561.750,00	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	12.04.2023	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	17.275.000,00	-



Stichtag 31.03.2023

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

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

	31.03.2023	31.03.2022
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

	31.03.2023	31.03.2022
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				
#	31.03.2023		31.03.2022	
	ISIN	Nennwert	ISIN	Nennwert
1	n/a	n/a	n/a	n/a

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

Namenspfandbriefe				
#	31.03.2023		31.03.2022	
	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 31.03.2023

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

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