



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

Stichtag 30.06.2023

(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>	
	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022
	<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0	93,1	100,4	83,3	87,4	105,0	116,5	83,3
<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	127,0	128,9	123,8	117,9	117,1	142,0	131,5	117,9	131,5
<i>davon Deckungswerte gem. § 20 Abs. 1 PfandBG</i>	125,5	120,5	113,2	117,4	103,9	112,6	124,4	122,5	103,9	122,5
<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	37,0	35,8	23,4	34,6	29,7	37,0	15,0	34,6	15,0
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	58,7%	41,1%	38,5%	23,3%	41,5%	34,0%	35,2%	12,9%	41,5%	12,9%
<i>Gesetzliche Überdeckung</i>	3,9	4,2	3,5	4,1	3,2	3,4	3,9	4,1	3,2	4,1
<i>nennwertige sichernde Überdeckung</i>	1,8	1,8	1,6	1,8	1,5	1,7	1,8	1,8	1,5	1,8
<i>barwertige sichernde Überdeckung</i>	2,1	2,4	1,9	2,3	1,7	1,7	2,1	2,3	1,7	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>	48,9	32,8	32,3	19,3	31,4	26,3	33,1	10,9	31,4	10,9

<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\*

30.06.2023	<= 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	37,0	0,0	58,5	0,0	17,3	30,0	0,0

30.06.2022	<= 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	40,0	0,0
<b>Deckungswerte</b>	25,0	0,0	0,0	0,0	37,0	58,5	0,0	1,0	5,5

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

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

30.06.2023	<= 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	40,0	0,0

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

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

	Nettobarwert	
	30.06.2023	30.06.2022
	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 30.06.2023

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

### Zinsstruktur\*

	Nennwert	
	30.06.2023	30.06.2022
<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	127,0
<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	
	30.06.2023	30.06.2022
<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 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)	
	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022
<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 30.06.2023

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

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022
	<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	
	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022
	<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	
	30.06.2023	30.06.2022	30.06.2023	30.06.2022
	<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

	30.06.2023	30.06.2022
<b>Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)</b>	-1.147.375,00	-
<b>Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt</b>	15.12.2023	-
<b>Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)</b>	17.275.000,00	-



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

Stichtag 30.06.2023

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

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

	30.06.2023	30.06.2022
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

	30.06.2023	30.06.2022
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				
#	30.06.2023		30.06.2022	
	ISIN	Nennwert	ISIN	Nennwert
1	n/a	n/a	n/a	n/a

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

Namenspfandbriefe				
#	30.06.2023		30.06.2022	
	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 30.06.2023

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

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