

Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG  
Stichtag 30.06.2022

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

## 1 GESAMTDECKUNGSSTOCK

### Im Umlauf befindliche gedeckte Schuldverschreibungen und dafür verwendete Deckungswerte

|  | Nominalwert |            | Barwert    |            | Risikobarwert - Hochzinsszenario* |            | Risikobarwert - Niedrigzinsszenario* |            | Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen und Zinsen* |            |
|--|-------------|------------|------------|------------|-----------------------------------|------------|--------------------------------------|------------|---|------------|
|  | 30.06.2022  | 30.06.2021 | 30.06.2022 | 30.06.2021 | 30.06.2022                        | 30.06.2021 | 30.06.2022                           | 30.06.2021 | 30.06.2022  | 30.06.2021 |
| Gedekte Schuldverschreibungen                                    | 2.670,8     | 3.862,3    | 2.970,6    | 4.535,2    | 2.756,2                           | 4.398,6    | 3.217,5                              | 4.680,8    | 2.756,2   | 4.398,6    |
| Deckungswerte §7 (2) DSLBUMwG                                    | 3.778,8     | 4.933,9    | 3.648,6    | 5.519,3    | 3.144,7                           | 5.196,8    | 4.334,7                              | 5.887,8    | 3.144,7   | 5.196,8    |
| davon Deckungswerte - Guthaben Deutsche Zentralbank <sup>1</sup> | 0,0         | 0,0        | 0,0        | 0,0        | 0,0                               | 0,0        | 0,0                                  | 0,0        | 0,0   | 0,0        |
| davon Deckungswerte - Guthaben Kreditinstitute <sup>1</sup>      | 0,0         | 0,0        | 0,0        | 0,0        | 0,0                               | 0,0        | 0,0                                  | 0,0        | 0,0   | 0,0        |
| Überdeckung  | 1.108,0     | 1071,6     | 678,0      | 984,1      | 388,5                             | 798,2      | 1.117,2                              | 1.207,0    | 388,5   | 798,2      |
| als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen            | 41,49%      | 27,75%     | 22,82%     | 21,70%     | 14,10%                            | 18,15%     | 34,72%                               | 25,79%     | 14,10%  | 18,15%     |

\* gemäß § 5 Abs. 1 Nr. 1 und § 6 Abs. 2 Nr. 1 PfandBarwertV statischer Ansatz

<sup>1</sup>gemäß § 7 Abs. 3 DSLBUMwG

### Laufzeitenstruktur der gedeckten Schuldverschreibungen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

| 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 |
|--------------------------------|-------------|---------------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|------------|
| gedeckte Schuldverschreibungen | 318,0       | 82,0                      | 216,5                      | 135,0                    | 568,3                  | 617,0                  | 300,0                  | 343,5                   | 90,5       |
| Deckungswerte                  | 470,5       | 329,0                     | 95,0                       | 81,5                     | 131,2                  | 191,1                  | 159,5                  | 761,4                   | 1.559,4    |

  

| 30.06.2021                     | <= 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 |
|--------------------------------|-------------|---------------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|------------|
| gedeckte Schuldverschreibungen | 766,5       | 425,0                     | 318,0                      | 82,0                     | 351,5                  | 568,3                  | 617,0                  | 593,0                   | 141,0      |
| Deckungswerte                  | 743,6       | 507,6                     | 494,5                      | 373,5                    | 249,4                  | 168,3                  | 159,7                  | 751,0                   | 1.486,3    |

### Laufzeitenstruktur der DSL Schuldverschreibungen mit Verlängerung von 12 Monaten

| 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 |
|--------------------------------|-------------|---------------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|------------|
| gedeckte Schuldverschreibungen | 0,0         | 0,0                       | 318,0                      | 82,0                     | 351,5                  | 568,3                  | 617,0                  | 593,0                   | 141,0      |

### Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

|  | Nettobarwert |            |
|--|--------------|------------|
|  | 30.06.2022   | 30.06.2021 |
|  | n/a          | n/a        |

### Zinsstruktur

|   | Nennwert Hypotheken |            |
|---|---------------------|------------|
|   | 30.06.2022          | 30.06.2021 |
| Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen       | 2.670,8             | 3.862,3    |
| als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen | 100,00%             | 100,00%    |
| Festverzinsliche Deckungswerte                        | 3.762,0             | 3.747,1    |
| als % der Deckungswerte                               | 99,55%              | 96,8%      |

Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBumwG  
Stichtag 30.06.2022

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

## 2 GLIEDERUNG DES DECKUNGSSTOCKS

### Hypothekendarlehen nach Größengruppen in Nennwerten

|                              | Nennwert       |                | % der Hypothekendarlehen |            |
|------------------------------|----------------|----------------|--------------------------|------------|
|                              | 30.06.2022     | 30.06.2021     | 30.06.2022               | 30.06.2021 |
| x <= 0,3 Mio EUR             | 2.531,2        | 2.884,1        | 92,8%                    | 90,9%      |
| 0,3 Mio EUR < x <= 1 Mio EUR | 120,7          | 132,6          | 4,4%                     | 4,3%       |
| 1 Mio EUR < x <= 10 Mio EUR  | 2,4            | 16,4           | 0,1%                     | 0,5%       |
| 10 Mio EUR < x               | 73,7           | 160,1          | 2,7%                     | 4,3%       |
|                              | <b>2.728,0</b> | <b>3.193,2</b> |                          |            |

### Kommaldarlehen und Wertpapiere für die ordentliche Deckung nach Größengruppen in Nennwerten

|                               | Nennwert       |                | % der Hypothekendarlehen |            |
|-------------------------------|----------------|----------------|--------------------------|------------|
|                               | 30.06.2022     | 30.06.2021     | 30.06.2022               | 30.06.2021 |
| x <= 10 Mio EUR               | 84,8           | 52,1           | 8,1%                     | 3,6%       |
| 10 Mio EUR < x <= 100 Mio EUR | 713,0          | 369,0          | 67,9%                    | 25,6%      |
| x > 100 Mio EUR               | 253,0          | 1.020,0        | 24,1%                    | 70,8%      |
|                               | <b>1.050,8</b> | <b>1.441,1</b> |                          |            |

|   | Nennwert   |            | als % der umlaufenden Pfandbriefe |            |
|---|------------|------------|-----------------------------------|------------|
|   | 30.06.2022 | 30.06.2021 | 30.06.2022                        | 30.06.2021 |
| Größte Geldforderung gegen Bundesbank                 | 0,0        | 299,5      | 0,00%                             | 7,75%      |
| <i>davon Grenzüberschreitung nach §7 (3) DSLBumwG</i> | 0,0        | 0,0        | 0,00%                             | 0,00%      |

## 3 WEITERE KENNZAHLEN

### Kennzahlen

|  | 30.06.2022 | 30.06.2021 |
|--|------------|------------|
| Durchschnittlicher, anhand des Betrages der zur Deckung verwendeten Forderungen gewichtete Beleihungsauslauf | 48,50%     | 52,6%      |
| Volumengewichteter Durchschnitt der seit der Hypothekendarlehensvergabe verstrichenen Laufzeit in Jahren     | 7,51       | 7,1        |



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG  
Stichtag 30.06.2022

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

Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen auf Hypothekenforderungen und deren Verteilung nach Staaten

|             | Nennwert Hypotheken |            | davon Forderungen mit mindestens 5% Rückstand |            | Nennwert Kommunal |            | davon Forderungen mit mindestens 5% Rückstand |            |
|-------------|---------------------|------------|---|------------|-------------------|------------|---|------------|
|             | 30.06.2022          | 30.06.2021 | 30.06.2022                                    | 30.06.2021 | 30.06.2022        | 30.06.2021 | 30.06.2022                                    | 30.06.2021 |
| Deutschland | 0.0                 | 0.1        | 0.0   | 0.1        | 0.0               | 0.0        | 0.0   | 0.0        |
|             | 0.0                 | 0.1        | 0.0   | 0.1        | 0.0               | 0.0        | 0.0   | 0.0        |