



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 <sup>1</sup>		Risikobarwert - Niedrigzinsszenario <sup>1</sup>		Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen <sup>1</sup>	
	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
	<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0	93,0	95,3	85,4	70,9	101,9	134,5	85,4
<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	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
<b>Überdeckung</b>	52,8	70,5	35,3	43,7	34,8	30,8	35,8	68,3	34,8	30,8
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	58,64%	78,33%	37,91%	45,87%	40,80%	43,37%	35,14%	50,80%	40,80%	43,37%
<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	40,2	31,6	28,2	32,1	63,4	31,6	28,2

<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\***

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
<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	0,0	0,0	10,0	0,0	40,0	0,0	0,0	40,0	0,0
<b>Deckungswerte</b>	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
<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>	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
<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

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
<b>Pfandbriefe + 12 Monate auf das Fälligkeitsdatum</b>	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
<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	** 160,5
<i>als % der Deckungsmasse</i>	100,00%	** 100,00%

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

Es wurde festgestellt, dass die mit \*\* gekennzeichneten Werte vom 30.09.2022 im ursprünglich veröffentlichten Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 nicht korrekt ausgewiesen worden sind. Auf Grund einer IT-Umstellung wurden nicht alle zum Stichtag 30.09.2022 für die Deckung verwendeten Kommunaldarlehen berücksichtigt. Die im vorliegenden Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 ausgewiesenen Werte vom 30.09.2022 werden hiermit korrigiert. Die gesetzlichen Anforderungen an die Deckung für die im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe wurden zu jeder Zeit eingehalten.

## 2 STRUKTUR DES DECKUNGSSTOCKES

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

	Nennwert	
	30.09.2023	30.09.2022
<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	** 125,5
<b>mehr als 100 Mio EUR</b>	0,0	0,0
	<b>125,5</b>	<b>** 125,5</b>

Es wurde festgestellt, dass die mit \*\* gekennzeichneten Werte vom 30.09.2022 im ursprünglich veröffentlichten Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 nicht korrekt ausgewiesen worden sind. Auf Grund einer IT-Umstellung wurden nicht alle zum Stichtag 30.09.2022 für die Deckung verwendeten Kommunaldarlehen berücksichtigt. Die im vorliegenden Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 ausgewiesenen Werte vom 30.09.2022 werden hiermit korrigiert. Die gesetzlichen Anforderungen an die Deckung für die im Umlauf befindlichen Öffentlichen Pfandbriefe wurden zu jeder Zeit eingehalten.

\* 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)	
	30.09.2023	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
<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 30.09.2023

(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
	<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	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
	<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	
	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2023	30.09.2022
	<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

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