



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief  
Stichtag 30.09.2022

(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>	
	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021
<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0	95,3	114,8	70,9	108,4	134,5	121,8	70,9	108,4
<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>	160,5	221,0	139,1	220,6	101,7	208,3	202,8	234,2	101,7	208,3
<i>davon Deckungswerte gem. § 20 Abs. 1 PfandBG</i>	125,5	215,5	112,0	215,2	86,8	203,2	155,6	228,3	86,8	203,2
<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>	70,5	131,0	43,7	105,8	30,8	99,9	68,3	112,4	30,8	99,9
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	78,3%	145,6%	45,9%	92,1%	43,4%	92,1%	50,8%	92,3%	43,4%	92,1%
<i>Gesetzliche Überdeckung</i>	5,3	4,2	4,3	4,2	2,7	3,9	4,9	4,3	2,7	3,9
<i>nennwertige sichere Überdeckung</i>	1,8	1,8	1,6	1,8	1,2	1,7	2,2	1,9	1,2	1,7
<i>barwertige sichere Überdeckung</i>	3,5	2,4	2,7	2,4	1,4	2,2	2,7	2,4	1,4	2,2
<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>	65,2	126,8	39,4	101,6	28,1	96,0	63,4	108,0	28,1	96,0

<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\*

30.09.2022	<= 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

30.09.2021	<= 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
<b>Öffentliche Pfandbriefe</b>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	10,0	40,0	25,0	15,0
<b>Deckungswerte</b>	30,0	25,0	0,0	0,0	0,0	37,0	0,0	129,0	0,0

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

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

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	
	30.09.2022	30.09.2021
	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 30.09.2022

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

### Zinsstruktur\*

	Nennwert	
	30.09.2022	30.09.2021
<b>Festverzinsliche Öffentliche Pfandbriefe</b>	90,0	90,0
<i>als % der umlaufenden Pfandbriefe</i>	100,00%	100,00%
<b>Festverzinsliche Deckungswerte</b>	160,5	221,0
<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	
	30.09.2022	30.09.2021
<b>bis einschließlich 10 Mio EUR</b>	0,0	5,5
<b>mehr als 10 Mio EUR bis zu 100 Mio EUR</b>	125,5	92,0
<b>mehr als 100 Mio EUR</b>	0,0	123,5
	<b>125,5</b>	<b>221,0</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	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	37,0	23,1%
<b>Niederlande</b>	88,5	0,0	0,0	0,0	88,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	88,5	55,1%
<b>Summe</b>	88,5	37,0	0,0	0,0	125,5	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	125,5	78,2%
<b>als % der Deckungswerte</b>	55,1%	23,1%	0,0%	0,0%		0,0%	0,0%	0,0%	0,0%			

\* 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		<i>davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)</i>		Insgesamt		<i>davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)</i>		Insgesamt		<i>davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)</i>	
			30.09.2022	30.09.2021			30.09.2022	30.09.2021			30.09.2022	30.09.2021
<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 30.09.2022

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

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021
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	
	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021
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	
	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021
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

	30.09.2022	30.09.2021
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für	-1.958.500,00	-
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	10.03.2023	-
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	35.000.000,00	-



## Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften - Öffentlicher Pfandbrief Stichtag 30.09.2022

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

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

	30.09.2022	30.09.2021
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

	30.09.2022	30.09.2021
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				
#	30.09.2022		30.09.2021	
	ISIN	Nennwert	ISIN	Nennwert
1	n/a	n/a	n/a	n/a

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

Namenspfandbriefe				
#	30.09.2022		30.09.2021	
	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

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