



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften  
Stichtag 30.09.2021

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

1 GESAMTDECKUNGSSTOCK

Im Umlauf befindliche Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte\*

	Nennwert		Barwert		Risikobarwert - Hochzinsszenario		Risikobarwert - Niedrigzinsszenario		Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
	Öffentliche Pfandbriefe	90,0	90,0	114,8	120,6	108,4	112,2	121,8	129,8	108,4
Deckungswerte	221,0	147,0	220,6	154,0	208,3	151,8	234,2	156,3	208,3	156,3
Deckungswerte gem. § 20 (1)	92,0	147,0	92,7	154,0	91,2	151,8	94,3	156,3	91,2	156,3
Deckungswerte gem. § 20 (2) Nr. 1 (siehe Fußnote)	129,0	0,0	127,9	0,0	117,0	0,0	139,9	0,0	117,0	0,0
Deckungswerte gem. § 20 (2) Nr. 2 <sup>1</sup>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
als % der umlaufenden Pfandbriefe	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Deckungswerte gem. § 20 (2) Nr. 3 (Forderungen)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
als % der gesamten Deckungswerte	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Deckungswerte gem. § 20 (2) Nr. 3 (Verbindlichkeiten)	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
als % der umlaufenden Pfandbriefe	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung	131,0	57,0	105,8	33,4	99,9	39,6	112,4	26,5	99,9	26,5
als % der umlaufenden Pfandbriefe	145,56%	63,3%	92,15%	27,7%	92,14%	35,3%	92,25%	20,4%	92,14%	20,4%

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

<sup>1</sup> inkl. Deckungswerte gem. § 4 Abs. 1 Satz 2 Nr. 3 PfandBG und § 4 (1) Satz 3 Nr. 2a und Nr. 3 PfandBG

Laufzeitenstruktur der Pfandbriefe sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte\*

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
Öffentliche Pfandbriefe	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	10,0	40,0	25,0	15,0
Deckungswerte	30,0	25,0	0,0	0,0	0,0	37,0	0,0	129,0	0,0

30.09.2020	<= 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
Öffentliche Pfandbriefe	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	10,0	65,0	15,0
Deckungswerte	45,0	20,0	30,0	25,0	7,0	0,0	20,0	0,0	0,0

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

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

EUR	Nettobarwert	
	30.09.2021	30.09.2020 <sup>1</sup>
	99,9	0,0
	99,9	0,0

\* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 10 PfandBG <sup>1</sup> Vorjahreswert nicht verfügbar

Zinsstruktur\*

	Nennwert	
	30.09.2021	30.09.2020
Festverzinsliche Öffentliche Pfandbriefe	90,0	90,0
als % der umlaufenden Pfandbriefe	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	221,0	147,0
als % der Deckungsmasse	100,00%	100,00%

\* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 9 PfandBG

## Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften Stichtag 30.09.2021

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

### 2 STRUKTUR DES DECKUNGSSTOCKES

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

	Nennwert	
	30.09.2021	30.09.2020
bis einschließlich 10 Mio EUR	0,0**	7,0
mehr als 10 Mio EUR bis zu 100 Mio EUR	92,0	140,0
mehr als 100 Mio EUR	123,5	0,0
<b>Summe</b>	<b>215,5</b>	<b>147,0</b>

\* gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 1 PfandBG

\*\* Es wurde festgestellt, dass im ursprünglich veröffentlichten Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2021 Deckungswerte der sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 S. 2 PfandBG i.H.v. ) Mio. EUR ausgewiesen wurden. Diese Deckungswerte werden nun nicht mehr angegeben. Die laufenden Deckungsrechnungen waren hierdurch nicht beeinträchtigt und die gesetzlichen Anforderungen an die Deckung für die im Umlauf befindlichen Pfandbriefe wurden zu jeder Zeit eingehalten.

#### Verteilung der verwendeten Forderungen nach Staaten und Schuldnerklassen\*

	Staat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige Schuldner	Summe	als % der regulären Deckungswerte
Deutschland	129,0	92,0	0,0	0,0	221,0	100,00%
als % der regulären Deckungswerte	58,37%	41,63%	0,00%	0,00%		

\* gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 2 PfandBG

#### Weitere Deckungswerte\*

	Forderungen gem. § 20 (2) Nr. 1		Forderungen gem. § 20 (2) Nr. 2		davon Forderungen gem. Verordnung (EU) Nr. 575/2013 Artikel 129 (gedeckte Schuldverschreibungen)	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
Deutschland	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>
davon Grenzüberschreitung nach § 20 (2)			0,0	0,0		

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
Größte Geldforderung gegen ein Kreditinstitut*	0,0	0,0	0,00%	0,00%
davon Grenzüberschreitung nach § 20 (2)	0,0	0,0	0,00%	0,00%

\* gemäß § 28 Abs. 1 Satz 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 8 PfandBG

	Nennwert		% der umlaufenden Pfandbriefe	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
Größte Geldforderung gegen Bundesbank*	0,0	0,0	0,00%	0,00%
davon Grenzüberschreitung nach § 20 (2)	0,0	0,0	0,00%	0,00%

\* gemäß § 20 (2) Nr. 2 PfandBG & gemäß § 4 (1) sentence 3 Nr. 2a PfandBG



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG gemäß § 28 PfandBG - Transparenzvorschriften  
Stichtag 30.09.2021

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

### 3 WEITERE KENNZAHLEN

#### Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen und deren Verteilung nach Staaten und Schuldnerklassen\*

	Nennwert		davon Forderungen mit mindestens 5% Rückstand	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
	Germany	0,0	0,0	0,0
	0,0	0,0	0,0	0,0

\* gemäß § 28 Abs. 3 Nr. 3 PfandBG

Fußnote:

Der irrtümlich unter §20 (2) No.1 ausgewiesene Wert ist dem Wert § 20 (1) zuzuordnen. Damit ist der Wert für Cover Assets acc to § 20 (1) im Ergebnis 221 Mio. Euro. Der Wert für Cover Assets acc. To § 20 (2) No. 1 beträgt hingegen im Ergebnis 0 Euro.