



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG
Stichtag 30.09.2023

(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*	
	30.09.2023	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
Gedekte Schuldverschreibungen	2.155,8	2.515,8	2.244,9	2.687,3	2.114,1	2.501,9	2.392,8	2.899,5	2.114,1	2.501,9
Deckungswerte §7 (2) DSLBUMwG	3.426,5	3.578,4	2.826,6	3.199,6	2.366,6	2.771,3	3.436,1	3.774,2	2.366,6	2.771,3
davon Deckungswerte - Guthaben Deutsche Zentralbank ¹	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
davon Deckungswerte - Guthaben Kreditinstitute ¹	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	1.270,7	1.062,6	581,8	512,3	252,5	269,5	1.043,3	874,7	252,5	269,5
als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen	58,94%	42,24%	25,91%	19,06%	11,94%	10,77%	43,60%	30,17%	11,94%	10,77%

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

¹gemäß § 7 Abs. 3 DSLBUMwG

Laufzeitenstruktur der gedeckten Schuldverschreibungen 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
gedeckte Schuldverschreibungen	151,5	125,0	303,3	365,0	602,0	185,0	243,0	181,0	0,0
Deckungswerte	49,1	42,6	41,3	57,3	81,8	156,7	261,1	1.351,4	1.385,0

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
gedeckte Schuldverschreibungen	173,0	187,0	151,5	125,0	668,3	602,0	185,0	424,0	0,0
Deckungswerte	340,0	266,7	92,5	51,5	104,2	220,5	176,0	856,7	1.359,0

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	30.09.2023	30.09.2022
	n/a	n/a

Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	30.09.2023	30.09.2022
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	2.155,8	2.515,8
als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	3.416,9	3.451,3
als % der Deckungswerte	99,72%	96,45%

