

Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG
Stichtag 30.09.2024

(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 - Niedrizinsszenario*		Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen und Zinsen*	
	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2024	30.09.2023
Gedekte Schuldverschreibungen	1.932,3	2.155,8	2.048,8	2.244,9	1.956,0	2.114,1	2.153,5	2.392,8	1.956,0	2.114,1
Deckungswerte §7 (2) DSLBUMwG	2.634,4	3.426,5	2.517,9	2.826,6	2.138,7	2.366,6	3.013,3	3.436,1	2.138,7	2.366,6
<i>davon Deckungswerte - Guthaben Deutsche Zentralbank¹</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<i>davon Deckungswerte - Guthaben Kreditinstitute¹</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	702,1	1.270,7	469,1	581,8	182,7	252,5	859,8	1.043,3	182,7	252,5
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	36,33%	58,94%	22,89%	25,91%	9,34%	11,94%	39,92%	43,60%	9,34%	11,94%

* 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

30.09.2024	<= 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	356,3	365,0	125,0	477,0	185,0	243,0	40,0	141,0	0,0
Deckungswerte	39,4	37,8	29,1	37,6	113,0	266,8	86,9	1.089,6	934,1

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

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	30.09.2024	30.09.2023
	n/a	n/a

Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	30.09.2024	30.09.2023
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	1.932,3	2.155,8
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	2.624,5	3.416,9
<i>als % der Deckungswerte</i>	99,63%	99,72%

