



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG
Stichtag 31.03.2023

(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*	
	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022	31.03.2023	31.03.2022
Gedekte Schuldverschreibungen	2.342,8	2.845,8	2.494,9	3.276,5	2.336,7	3.033,6	2.674,7	3.557,8	2.336,7	3.033,6
Deckungswerte §7 (2) DSLBUMwG	3.442,7	3.983,1	3.051,0	4.163,5	2.596,8	3.535,8	3.654,1	5.029,7	2.596,8	3.535,8
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	1.099,9	1.137,3	556,1	887,0	260,1	502,2	979,3	1.471,9	260,1	502,2
als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen	46,95%	39,96%	22,29%	27,07%	11,13%	16,55%	36,61%	41,37%	11,13%	16,55%

* 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

31.03.2023	<= 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	187,0	151,5	125,0	303,3	490,0	502,0	250,0	334,0	0,0
Deckungswerte	296,3	78,8	49,0	50,4	101,3	119,7	303,0	1.227,1	1.217,1

31.03.2022	<= 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	330,0	173,0	187,0	151,5	428,3	490,0	502,0	443,0	141,0
Deckungswerte	301,7	316,1	284,2	121,0	128,4	189,2	159,6	805,7	1.677,1

Laufzeitenstruktur der DSL Schuldverschreibungen mit Verlängerung von 12 Monaten

31.03.2023	<= 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	0,0	0,0	187,0	151,5	428,3	490,0	502,0	443,0	141,0

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	31.03.2023	31.03.2022
	n/a	n/a

Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	31.03.2023	31.03.2022
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	2.342,8	2.845,8
als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	3.430,9	3.918,5
als % der Deckungswerte	99,66%	98,38%

