

Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG
Stichtag 31.12.2023

(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*	
	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022	31.12.2023	31.12.2022
Gedekte Schuldverschreibungen	2.137,8	2.352,8	2.286,7	2.496,6	2.161,0	2.326,8	2.428,9	2.690,0	2.161,0	2.326,8
Deckungswerte §7 (2) DSLBUMwG	3.178,8	3.173,4	2.933,5	2.789,7	2.460,1	2.392,6	3.559,0	3.322,1	2.460,1	2.392,6
<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	1.041,0	820,6	646,8	293,1	299,2	65,8	1.130,1	632,0	299,2	65,8
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	48,69%	34,88%	28,29%	11,74%	13,85%	2,83%	46,53%	23,50%	13,85%	2,83%

* 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

31.12.2023	<= 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	218,5	195,0	373,3	160,0	582,0	210,0	218,0	181,0	0,0
Deckungswerte	59,6	33,9	52,0	37,1	94,4	168,7	234,2	1.355,4	1.143,5

31.12.2022	<= 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	82,0	216,5	135,0	195,0	533,3	582,0	210,0	399,0	0,0
Deckungswerte	346,9	92,0	76,6	45,5	121,0	133,8	186,7	867,3	1.303,7

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	31.12.2023	31.12.2022
	n/a	n/a

Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	31.12.2023	31.12.2022
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	2.137,8	2.352,8
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	3.170,0	3.159,1
<i>als % der Deckungswerte</i>	99,72%	99,55%

