



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG  
Stichtag 30.09.2022

(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*	
	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2022	30.09.2021
Gedekte Schuldverschreibungen	2.515,8	3.565,8	2.687,3	4.182,2	2.501,9	3.881,1	2.899,5	4.533,6	2.501,9	3.881,1
Deckungswerte §7 (2) DSLBUMwG	3.578,4	4.454,1	3.199,6	4.941,2	2.771,3	4.150,0	3.774,2	6.043,9	2.771,3	4.150,0
davon Deckungswerte - Guthaben Deutsche Zentralbank <sup>1</sup>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
davon Deckungswerte - Guthaben Kreditinstitute <sup>1</sup>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	1.062,6	888,3	512,3	759,0	269,5	268,8	874,7	1.510,2	269,5	268,8
als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen	42,24%	24,91%	19,06%	18,15%	10,77%	6,93%	30,17%	33,31%	10,77%	6,93%

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

<sup>1</sup>gemäß § 7 Abs. 3 DSLBUMwG

### Laufzeitenstruktur der gedeckten Schuldverschreibungen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

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	281,9	119,6	55,1	135,7	221,1	177,7	861,9	1.385,4

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
gedeckte Schuldverschreibungen	720,0	330,0	173,0	187,0	276,5	668,3	602,0	468,0	141,0
Deckungswerte	303,3	233,6	316,1	287,1	191,0	165,3	137,3	1.189,1	1.631,2

### Laufzeitenstruktur der DSL Schuldverschreibungen mit Verlängerung von 12 Monaten

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	0,0	0,0	173,0	187,0	276,5	668,3	602,0	468,0	141,0

### Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	30.09.2022	30.09.2021
	n/a	n/a

### Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	30.09.2022	30.09.2021
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	2.515,8	3.565,8
als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	3.562,7	4.368,6*
als % der Deckungswerte	99,56%	98,08%

\* Für den historischen Wert 30.09.2021 wurde der festverzinsliche Deckungswert inkl. des prozentualen Anteils als zu gering ausgewiesen (46.7 mn €). Die aktuell angezeigten Werte sind berichtigt.

