

## 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 <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	1.270,7	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

<sup>1</sup>gemäß § 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	** 281,9	** 119,6	** 55,1	** 135,7	** 221,1	** 177,7	** 861,9	** 1.385,4

Es wurde festgestellt, dass die mit \*\* gekennzeichneten Werte vom 30.09.2022 im ursprünglich veröffentlichten Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 nicht korrekt ausgewiesen worden sind. Auf Grund einer IT-Umstellung wurden nicht alle zum Stichtag 30.09.2022 für die Deckung verwendeten Kommunaldarlehen berücksichtigt. Die im vorliegenden Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 ausgewiesenen Werte vom 30.09.2022 werden hiermit korrigiert. Die gesetzlichen Anforderungen an die Deckung für die im Umlauf befindlichen DSLBUMwG - Gedeckte Schuldverschreibungen wurden zu jeder Zeit eingehalten.

#### 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	** 3.562,7
als % der Deckungswerte	99,72%	** 99,56%

Es wurde festgestellt, dass die mit \*\* gekennzeichneten Werte vom 30.09.2022 im ursprünglich veröffentlichten Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 nicht korrekt ausgewiesen worden sind. Auf Grund einer IT-Umstellung wurden nicht alle zum Stichtag 30.09.2022 für die Deckung verwendeten Kommunaldarlehen berücksichtigt. Die im vorliegenden Transparenzreport zum Stichtag 30.09.2023 ausgewiesenen Werte vom 30.09.2022 werden hiermit korrigiert. Die gesetzlichen Anforderungen an die Deckung für die im Umlauf befindlichen DSLBUMwG - Gedeckte Schuldverschreibungen wurden zu jeder Zeit eingehalten.

