

Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBUMwG
Stichtag 30.09.2021

(Alle Angaben in Mio EUR, soweit nichts anderes angegeben)

1 GESAMTDECKUNGSSTOCK

Im Umlauf befindliche gedeckte Schuldverschreibung und dafür verwendete Deckungswerte*

	Nominalwert		Barwert		Risikobarwert - Hochzinsszenario		Risikobarwert - Niedrigzinsszenario		Risikobarwert - Worst Case Szenario inkl. Währungsveränderungen und	
	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2021	30.09.2020
Gedekte Schuldverschreibungen	3.565,8	0,0	4.182,2	0,0	3.881,1	0,0	4.533,6	0,0	3.881,1	0,0
Deckungswerte §7 (2)	4.454,1	0,0	4.941,2	0,0	4.150,0	0,0	6.043,9	0,0	4.150,0	0,0
<i>davon Deckungswerte nach §7(3) Guthaben Deutsche</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<i>davon Deckungswerte nach §7(3) Guthaben Kredit</i>	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Überdeckung	888,3	0,0	759,0	0,0	268,8	0,0	1.510,2	0,0	268,8	0,0
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	24,91%	0,00%	18,15%	0,00%	6,93%	0,00%	33,31%	0,00%	6,93%	0,00%

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

Laufzeitenstruktur der gedeckten Schuldverschreibungen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

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

30.09.2020	<= 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	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Deckungswerte	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV*

	Nettobarwert	
	30.09.2021	30.09.2020
EUR	268.8	
	268.8	

Zinsstruktur*

	Nennwert Hypotheken	
	30.09.2021	30.09.2020
Festverzinsliche gedeckten	3.565,8	0,0
<i>als % der umlaufenden gedeckten</i>	100,00%	0,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	4.321,9	0,0
<i>als % der Deckungswerte</i>	97,08%	0,00%

