



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBÜmwG Stichtag 31.12.2021

(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*	
	31.12.2021	31.12.2020	31.12.2021	31.12.2020	31.12.2021	31.12.2020	31.12.2021	31.12.2020	31.12.2021	31.12.2020
	Gedeckte Schuldverschreibungen	3.095,8	4.702,3	3.650,5	5.535,3	3.375,2	5.361,4	3.971,3	5.721,4	3.375,2
Deckungswerte §7 (2) DSLBÜmwG	4.190,4	5.498,1	** 4.663,7	6.256,2	** 3.929,1	5.873,2	** 5.688,0	6.693,1	** 3.929,1	5.873,2
<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	1.094,6	795,8	** 1.013,2	720,9	** 553,9	511,8	** 1.716,7	971,8	** 553,9	511,8
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	35,36%	16,92%	** 27,76%	13,02%	** 16,41%	9,55%	** 43,23%	16,98%	** 16,41%	9,55%

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

¹gemäß § 7 Abs. 3 DSLBÜmwG

** Es wurde festgestellt, dass die mit ** gekennzeichneten Barwerte vom 31.12.2021 im ursprünglich veröffentlichten Transparenzreport zum Stichtag 31.12.2021 nicht korrekt ausgewiesen worden sind. Anstelle der Barwerte per 31.12.2021 wurden die Barwerte per 03.01.2022 angezeigt. Dieser auf eine fehlerhafte Datenzuweisung zurückzuführende Fehler wird hiermit korrigiert. Dementsprechend sind auch die im Transparenzreport zum Stichtag 31.12.2022 auszuweisenden Barwerte des Vorjahres korrigiert worden. Die laufenden Deckungsrechnungen waren hierdurch nicht beeinträchtigt und die gesetzlichen Anforderungen an die Deckung für die im Umlauf befindlichen Pfandbriefe wurden zu jeder Zeit eingehalten.

Laufzeitenstruktur der gedeckten Schuldverschreibungen sowie Zinsbindungsfristen der Deckungswerte

31.12.2021	<= 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	425,0	318,0	82,0	216,5	330,0	533,3	582,0	468,0	141,0
Deckungswerte	184,1	447,7	331,4	96,8	201,7	214,3	153,9	834,9	1.725,5

31.12.2020	<= 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	840,0	766,5	425,0	318,0	298,5	330,0	533,3	1.050,0	141,0
Deckungswerte	580,4	416,3	266,1	471,9	590,9	238,4	170,5	1.409,0	1.354,6

Laufzeitenstruktur der DSL Schuldverschreibungen mit Verlängerung von 12 Monaten

31.12.2021	<= 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	0,0	0,0	425,0	318,0	298,5	330,0	533,3	1.050,0	141,0

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	31.12.2021	31.12.2020
	n/a	n/a

Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	31.12.2021	31.12.2020
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	3.095,8	4.702,3
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	4.123,8	5.296,5
<i>als % der Deckungswerte</i>	98,41%	96,30%

