



Veröffentlichung der Deutschen Bank AG nach DSLBÜmwG Stichtag 31.12.2022

(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*	
	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2022	31.12.2021
Gedekte Schuldverschreibungen	2.352,8	3.095,8	2.496,6	3.650,5	2.326,8	3.375,2	2.690,0	3.971,3	2.326,8	3.375,2
Deckungswerte §7 (2) DSLBÜmwG	3.173,4	4.190,4	2.789,7	** 4.663,7	2.392,6	** 3.929,1	3.322,1	** 5.688,0	2.392,6	** 3.929,1
<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	820,6	1.094,6	293,1	** 1.013,2	65,8	** 553,9	632,0	** 1.716,7	65,8	** 553,9
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	34,88%	35,36%	11,74%	** 27,76%	2,83%	** 16,41%	23,50%	** 43,23%	2,83%	** 16,41%

* 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 Transparenzreport zum Stichtag 31.12.2021 nicht korrekt ausgewiesen worden sind. An Stelle der Barwerte per 31.12.2021 wurden die Barwerte vom 03.01.2022 angezeigt. Dieser auf eine fehlerhafte Datenzuweisung zurückzuführende Fehler wurde bei der Erstellung des aktuellen Transparenzreports zum 31.12.2022 korrigiert. Dementsprechend waren sind auch die zum Vorjahresvergleich ausgewiesenen Barwerte vom 31.12.2021 zu korrigieren. Die Berichtigung der Barwerte im Transparenzreport zum Stichtag 31.12.2021 wird zeitnah veröffentlicht. Die laufende Deckungsrechnungen waren durch diesen Fehler 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

31.12.2022	<= 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

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

Laufzeitenstruktur der DSL Schuldverschreibungen mit Verlängerung von 12 Monaten

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	0,0	0,0	82,0	216,5	330,0	533,3	582,0	468,0	141,0

Barwerte in EUR nach Währungen gem. § 6 PfandBarwertV

	Nettobarwert	
	31.12.2022	31.12.2021
	n/a	n/a

Zinsstruktur

	Nennwert Hypotheken	
	31.12.2022	31.12.2021
Festverzinsliche gedeckte Schuldverschreibungen	2.352,8	3.095,8
<i>als % der umlaufenden gedeckten Schuldverschreibungen</i>	100,00%	100,00%
Festverzinsliche Deckungswerte	3.159,1	4.123,8
<i>als % der Deckungswerte</i>	99,55%	98,41%

