

Vorstand
C 30-2/R 3
19. Juli 2012

Geschäftsbedingungen

Bekanntmachung von Änderungen der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank ab 20. August 2012

Die Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank (AGB), veröffentlicht in der Mitteilung Nr. 2011/2001 vom 9. November 2001 (BAnz. Nr. 223a vom 29. November 2001), zuletzt geändert durch die Mitteilung Nr. 2004/2012 vom 25. Mai 2012 (BAnz AT 31.05.2012 B6), werden – wie aus der beigefügten Anlage ersichtlich – geändert.

Die Änderungen gelten gegenüber den Geschäftspartnern der Deutschen Bundesbank, die Kaufleute oder öffentliche Verwaltungen sind, ab 20. August 2012 als vereinbart.

Deutsche Bundesbank
Dr. h. c. Böhmler Lipp

Anlage

Telefon	Termin	Vordr.	Vorgang	Überholt
069 9566-4497 oder 069 9566-0	Veröffentlicht im Bundesanzeiger AT vom 20. Juli 2012		Mitteilung 2004/2012	

**Änderungen der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank (AGB)
 ab 20. August 2012**

Abschnitt V Geldpolitische Geschäfte

1) Im Anschluss an Nummer 3 Absatz 2 Satz 3 wird folgender Satz als neuer Satz 4 eingefügt:

„Schuldverschreibungen im Sinne der Sätze 1 und 2, für die eine öffentliche Stelle mit Steuererhebungsrecht in Ländern des Europäischen Wirtschaftsraums eine Garantie übernommen hat (Government Guaranteed Bank Bond), kann der Geschäftspartner nur begrenzt nutzen; die Grenze bildet der Nominalwert an Schuldverschreibungen dieser Art, die der Geschäftspartner am 3. Juli 2012 bei der Bank als Sicherheit hinterlegt hatte.“

2) Die zweite Tabelle in Nummer 4 Absatz 5 Unterabsatz a wird durch folgende Tabelle ersetzt:

Bonität	Rest-laufzeit (Jahre)	Liquiditätskategorie⁴								
		I		II		III		IV		V
		Festverzinslich	Nullkupon	Festverzinslich	Nullkupon	Festverzinslich	Nullkupon	Festverzinslich	Nullkupon	ABS⁵
AAA bis A-	0-1	0,5 %	0,5 %	1,0 %	1,0 %	1,5 %	1,5 %	6,5 %	6,5 %	16,0 %
	1-3	1,5 %	1,5 %	2,5 %	2,5 %	3,0 %	3,0 %	8,5 %	9,0 %	16,0 %
	3-5	2,5 %	3,0 %	3,5 %	4,0 %	5,0 %	5,5 %	11,0 %	11,5 %	16,0 %
	5-7	3,0 %	3,5 %	4,5 %	5,0 %	6,5 %	7,5 %	12,5 %	13,5 %	16,0 %
	7-10	4,0 %	4,5 %	5,5 %	6,5 %	8,5 %	9,5 %	14,0 %	15,5 %	16,0 %
	> 10	5,5 %	8,5 %	7,5 %	12,0 %	11,0 %	16,5 %	17,0 %	22,5 %	16,0 %

3) Die dritte Tabelle von Nummer 4 Absatz 5 Unterabsatz a wird durch folgende Tabelle ersetzt:

Bonität	Rest-laufzeit (Jahre)	Liquiditätskategorie⁴									
		I		II		III		IV		V	
		Festverzinslich	Nullkupon	Festverzinslich	Nullkupon	Festverzinslich	Nullkupon	Festverzinslich	Nullkupon	CMBS⁶	Andere ABS⁷
BBB + bis BBB-	0-1	5,5 %	5,5 %	6,0 %	6,0 %	8,0 %	8,0 %	15,0 %	15,0 %	32,0 %	26,0 %
	1-3	6,5 %	6,5 %	10,5 %	11,5 %	18,0 %	19,5 %	27,5 %	29,5 %	32,0 %	26,0 %
	3-5	7,5 %	8,0 %	15,5 %	17,0 %	25,5 %	28,0 %	36,5 %	39,5 %	32,0 %	26,0 %
	5-7	8,0 %	8,5 %	18,0 %	20,5 %	28,0 %	31,5 %	38,5 %	43,0 %	32,0 %	26,0 %
	7-10	9,0 %	9,5 %	19,5 %	22,5 %	29,0 %	33,5 %	39,0 %	44,5 %	32,0 %	26,0 %
	> 10	10,5 %	13,5 %	20,0 %	29,0 %	29,5 %	38,0 %	39,5 %	46,0 %	32,0 %	26,0 %

4) Die bisherigen Fußnoten 5 und 6 im Abschnitt V erhalten die Nummern 8 und 9.

⁴ Bei Jumbo-Pfandbriefen, traditionellen Pfandbriefen, sonstigen gedeckten Bankschuldverschreibungen, ungedeckten Schuldtiteln von Kreditinstituten sowie Asset-Backed Securities, die einer theoretischen Bepreisung unterliegen, fällt vorab ein zusätzlicher Abschlag von 5 % (valuation markdown) an, der bereits im Rahmen der Wertermittlung in Abzug gebracht wird.

⁵ Asset-Backed Securities, die über zwei Ratings von mindestens A- verfügen.

⁶ Mit gewerblichen Hypothekarkrediten gedeckte Asset-Backed Securities (CMBS), die nicht über zwei Ratings von mindestens A- verfügen.

⁷ Andere Asset-Backed Securities, die nicht über zwei Ratings von mindestens A- verfügen.