

Vorstand
C 30-2/R 3
24. Oktober 2012

Geschäftsbedingungen

Bekanntmachung von Änderungen der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank ab 1. Dezember 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. 2010/2012 vom 8. August 2012 (BAnz AT 16.08.2012 B7), werden – wie aus der beigefügten Anlage ersichtlich – geändert.

Die Änderungen gelten gegenüber den Geschäftspartnern der Deutschen Bundesbank, die Kaufleute oder öffentliche Verwaltungen sind, ab 1. Dezember 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 31. Oktober 2012		Mitteilung 2010/2012	

**Änderungen der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank (AGB)
 ab 1. Dezember 2012**

Abschnitt V Geldpolitische Geschäfte

1) In Nummer 4 Absatz 5 Unterabsatz a erhält die Fußnote 2 in der ersten Tabelle folgende neue Fassung:

„Jumbo-Pfandbriefe sind Pfandbriefe mit einem Emissionsvolumen von mindestens 1 Mrd. Euro, für die regelmäßige Kauf- und Verkaufskurse von mindestens drei Market-Makern erhältlich sind.“

2) In Nummer 4 Absatz 5 Unterabsatz a wird die zweite Tabelle durch folgende Tabelle ersetzt:

Bonität	Rest-lauf-zeit (Jahre)	Liquiditätskategorie^{4, 4a}								
		I		II		III		IV		V
		Festver-zinslich	Null-kupon	Festver-zinslich	Null-kupon	Festver-zinslich	Null-kupon	Festver-zinslich	Null-kupon	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) In Nummer 4 Absatz 5 Unterabsatz a wird die dritte Tabelle durch folgende Tabelle ersetzt:

Bonität	Rest-lauf-zeit (Jahre)	Liquiditätskategorie^{4, 4a}									
		I		II		III		IV		V	
		Festver-zinslich	Null-kupon	Festver-zinslich	Null-kupon	Festver-zinslich	Null-kupon	Festver-zinslich	Null-kupon	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 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.

^{4a} Bei in Pfund Sterling (GBP) oder US-Dollar (USD) denominierten Wertpapieren wird ein zusätzlicher Bewertungsabschlag in Höhe von 16 % auf den Wert nach Abzug der übrigen Abschläge vorgenommen. Bei in Yen (JPY) denominierten Wertpapieren wird ein zusätzlicher Bewertungsabschlag in Höhe von 26 % auf den Wert nach Abzug der übrigen Abschläge vorgenommen.

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.