

Vorstand
C 30-2/R 3
30. September 2013

Geschäftsbedingungen

Bekanntmachung von Änderungen der Allgemeinen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank ab 4. November 2013

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. 2004/2013 vom 16. August 2013 (BAnz AT 22.08.2013 B4), werden – wie aus der beigefügten Anlage ersichtlich – geändert.

Die Änderungen gelten gegenüber den Geschäftspartnern der Deutschen Bundesbank, die Kaufleute oder öffentliche Verwaltungen sind, ab 4. November 2013 als vereinbart. Es wird darauf hingewiesen, dass diese Änderungen gemäß den Entscheidungen EZB/2013/35 und EZB/2013/36 bereits seit dem 1. Oktober 2013 unmittelbar anwendbar sind.

Deutsche Bundesbank
Dr. h. c. Böhmler Lipp

Anlage

Telefon	Termin	Vodr.	Vorgang	Überholt
069 9566-4497 oder 069 9566-0	Veröffentlicht im Bundesanzeiger AT vom 2. Oktober 2013		Mitteilung 2004/2013	

**Änderungen der Allgemeinen Geschäftsbedingungen
der Deutschen Bundesbank (AGB)
ab 4. November 2013**

Abschnitt V Geldpolitische Geschäfte

1) Die zweite und dritte Tabelle in Nummer 4 Absatz 5 Unterabsatz a werden samt Fußnoten wie folgt neu gefasst:

”

<u>Bonität</u>	Rest- lauf- zeit (Jahre)	Liquiditätskategorie ^{4, 4a}								
		I		II ⁵		III ⁵		IV		V
		Festver- zinslich	Null- kupon	Festver- zinslich	Null- kupon	Festver- zinslich	Null- kupon	Festver- zinslich	Null- kupon	ABS ⁶
AAA bis A-	0-1	0,5 %	0,5 %	1,0 %	1,0 %	1,0 %	1,0 %	6,5 %	6,5 %	10,0 %
	1-3	1,0 %	2,0 %	1,5 %	2,5 %	2,0 %	3,0 %	8,5 %	9,0 %	10,0 %
	3-5	1,5 %	2,5 %	2,5 %	3,5 %	3,0 %	4,5 %	11,0 %	11,5 %	10,0 %
	5-7	2,0 %	3,0 %	3,5 %	4,5 %	4,5 %	6,0 %	12,5 %	13,5 %	10,0 %
	7-10	3,0 %	4,0 %	4,5 %	6,5 %	6,0 %	8,0 %	14,0 %	15,5 %	10,0 %
	> 10	5,0 %	7,0 %	8,0 %	10,5 %	9,0 %	13,0 %	17,0 %	22,5 %	10,0 %

<u>Bonität</u>	Rest- lauf- zeit (Jahre)	Liquiditätskategorie ^{4, 4a}								
		I		II ⁵		III ⁵		IV		V
		Festver- zinslich	Null- kupon	Festver- zinslich	Null- kupon	Festver- zinslich	Null- kupon	Festver- zinslich	Null- kupon	ABS ⁶
BBB + bis BBB-	0-1	6,0 %	6,0 %	7,0 %	7,0 %	8,0 %	8,0 %	13,0 %	13,0 %	22,0 %
	1-3	7,0 %	8,0 %	10,0 %	14,5 %	15,0 %	16,5 %	24,5 %	26,5 %	22,0 %
	3-5	9,0 %	10,0 %	15,5 %	20,5 %	22,5 %	25,0 %	32,5 %	36,5 %	22,0 %
	5-7	10,0 %	11,5 %	16,0 %	22,0 %	26,0 %	30,0 %	36,0 %	40,0 %	22,0 %
	7-10	11,5 %	13,0 %	18,5 %	27,5 %	27,0 %	32,5 %	37,0 %	42,5 %	22,0 %
	> 10	13,0 %	16,0 %	22,5 %	33,0 %	27,5 %	35,0 %	37,5 %	44,0 %	22,0 %

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 Ab 1. November 2013: Werden im Eurosystem mehr als 75 % des ausstehenden Nominalbetrags einer gedeckten Bankschuldverschreibung als Sicherheit von Geschäftspartnern genutzt, die selbst Emittent des Wertpapiers sind bzw. in enger Verbindung im Sinne von Nummer 3 Absatz 5 mit dem Emittenten stehen, fällt für die gesamte Emission vorab ein zusätzlicher Abschlag an, der bereits im Rahmen der Wertermittlung in Abzug gebracht wird. Er beträgt bei einem Rating von mindestens A- 8 %, sonst 12 %.

⁶ Der niedrigere Abschlag von 10 % gilt nur für ABS, die über zwei Ratings von mindestens A- verfügen.“

2) Die Übersicht über die Abschläge am Ende von Nummer 4 Absatz 7 Satz 4 wird wie folgt neu gefasst:

„

<u>Bonität</u>	<u>Restlaufzeit</u>	<u>Abschlag</u>	<u>Restlaufzeit</u>	<u>Abschlag</u>
AAA	0-1 Jahr	12,0 %	5-7 Jahre	27,0 %
bis	1-3 Jahre	16,0 %	7-10 Jahre	35,0 %
A-	3-5 Jahre	21,0 %	> 10 Jahre	45,0 %

<u>Bonität</u>	<u>Restlaufzeit</u>	<u>Abschlag</u>	<u>Restlaufzeit</u>	<u>Abschlag</u>
BBB+	0-1 Jahr	19,0 %	5-7 Jahre	52,0 %
bis	1-3 Jahre	34,0 %	7-10 Jahre	58,0 %
BBB-	3-5 Jahre	46,0 %	> 10 Jahre	65,0 %

„

3) Die Fußnote in Nummer 13 Absatz 4 wird wie folgt neu gefasst:

„Zurzeit nur nach irischem Recht; abweichend von Nummer 4 Absatz 7 beträgt der Bewertungsabschlag 39,5 % des Nominalbetrags des Solawechsels.“