

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:

<b>Bonität</b>	<b>Rest-laufzeit</b> (Jahre)	<b>Liquiditätskategorie<sup>4</sup></b>								
		<b>I</b>		<b>II</b>		<b>III</b>		<b>IV</b>		<b>V</b>
		<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>ABS<sup>5</sup></b>
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:

<b>Bonität</b>	<b>Rest-laufzeit</b> (Jahre)	<b>Liquiditätskategorie<sup>4</sup></b>									
		<b>I</b>		<b>II</b>		<b>III</b>		<b>IV</b>		<b>V</b>	
		<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>Festverzinslich</b>	<b>Nullkupon</b>	<b>CMBS<sup>6</sup></b>	<b>Andere ABS<sup>7</sup></b>
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.

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> Asset-Backed Securities, die über zwei Ratings von mindestens A- verfügen.

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

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