

Zentrale
M 330

Wilhelm-Epstein-Straße 14
60431 Frankfurt am Main

Telefon: 069 9566-2995
Telefax: 069 5601071

zentrale.bbk@bundesbank.de
www.bundesbank.de

30. Dezember 2003

Rundschreiben Nr. 66/2003

An alle
Kreditinstitute

Regelungen für den Verkauf von Daueremissionen des Bundes und vorzeitige Rückgaben von Bundesschatzbriefen zwischen den Kreditinstituten und den Hauptverwaltungen der Deutschen Bundesbank

Sehr geehrte Damen und Herren,

beigefügt erhalten Sie die überarbeiteten „Regelungen für den Verkauf von Daueremissionen des Bundes und vorzeitige Rückgaben von Bundesschatzbriefen zwischen den Kreditinstituten und den Hauptverwaltungen der Deutschen Bundesbank (Fassung Januar 2004)“.

In Ziffer 2.2 wurde ein Abschnitt mit der Regelung des Verkaufsgeschäfts von Daueremissionen des Bundes an regionalen Feiertagen aufgenommen.

Die Regelungen werden als Mitteilung der Deutschen Bundesbank im Bundesanzeiger veröffentlicht.

Mit freundlichen Grüßen
DEUTSCHE BUNDESBANK
Nimmerrichter Dr. Schmidt



Beglaubigt:

Bundesbankangestellte

Anlage

Regelungen für den Verkauf von Daueremissionen des Bundes und vorzeitige Rückgaben von Bundesschatzbriefen zwischen den Kreditinstituten und den Hauptverwaltungen der Deutschen Bundesbank (Fassung Januar 2004)

- 1 Die Bundesrepublik Deutschland begibt Bundesschatzbriefe und Finanzierungsschätze als Daueremissionen. Für deren Ausgabe und Verkauf sind die jeweiligen Emissionsbedingungen sowie die Bedingungen für Kreditinstitute maßgebend. Die Daueremissionen des Bundes werden von Kreditinstituten im Auftrag und für Rechnung des Bundesministeriums der Finanzen unter Mitwirkung der Deutschen Bundesbank und deren Hauptverwaltungen verkauft.

- 2 Für die Abwicklung des Verkaufs zwischen den Kreditinstituten und den Hauptverwaltungen der Deutschen Bundesbank gelten nachfolgende Regelungen:
 - 2.1 Zur Beteiligung am Verkauf von Bundesschatzbriefen und Finanzierungsschätzen haben Kreditinstitute mit einem zur Börsengeschäftsabwicklung (XONTRO) der Deutsche Börse AG berechtigten Depotkonto bei der Clearstream Banking AG Frankfurt ein schriftliches Anerkenntnis der „Bedingungen für Kreditinstitute für den Verkauf“ bei der Wertpapierabteilung der zuständigen Hauptverwaltung der Deutschen Bundesbank einzureichen.

 - 2.2 Kreditinstitute geben die bis 12.00 Uhr von ihren Kunden erteilten Kaufaufträge sowie die über andere Kreditinstitute erhaltenen Kundenaufträge für Bundesschatzbriefe und Finanzierungsschätze gesammelt telefonisch, per Telefax oder schriftlich formlos geschäftstäglich bis 13.00 Uhr an die Wertpapierabteilung der zuständigen Hauptverwaltung der Deutschen Bundesbank weiter.

Nach 12.00 Uhr bei Kreditinstituten eingehende Aufträge zum Erwerb von Bundesschatzbriefen und Finanzierungsschätzen werden hinsichtlich Zins- bzw. Stückzinsberechnung und Beginn der zweitägigen Valutierungsfrist als am nächsten Geschäftstag bis 12.00 Uhr erteilt behandelt und zu den dann geltenden Konditionen abgerechnet.

Die bei Kreditinstituten am Geschäftstag vor einem regionalen Feiertag nach 12.00 Uhr (sowie die ggf. am regionalen Feiertag bis 12.00 Uhr) eingehenden Aufträge zum Erwerb von Bundesschatzbriefen und Finanzierungsschätzen werden hinsichtlich Konditionen, Zins- bzw. Stückzinsberechnung und Beginn der zweitägigen Valutierungsfrist als am regionalen Feiertag bis 12.00 Uhr erteilt behandelt. Die Aufträge sind von den Kreditinstituten bis spätestens 13.00 Uhr des regionalen Feiertags gesammelt ausschließ-

lich per Telefax an die Wertpapierabteilung der zuständigen Hauptverwaltung der Deutschen Bundesbank zu übermitteln. Die Abrechnung erfolgt am Geschäftstag nach dem regionalen Feiertag.

2.3 Filialen von Kreditinstituten ohne eigenes XONTRO-berechtigtes Konto bei der Clearstream Banking AG Frankfurt geben die von den Kunden erhaltenen Kaufaufträge für Bundesschatzbriefe und Finanzierungsschätze an ihre Zentrale bzw. Kopfstelle, Sparkassen und Kreditgenossenschaften an die regionale Girozentrale bzw. genossenschaftliche Zentralbank weiter. Andere Kreditinstitute ohne eigenes XONTRO-berechtigtes Konto bei der Clearstream Banking AG Frankfurt leiten die Kaufaufträge ihrer Kunden über ein Kreditinstitut mit einem solchen Konto.

2.4 Die Wertpapierabteilungen der Hauptverwaltungen der Deutschen Bundesbank rechnen die geschäftstäglich bis 13.00 Uhr bei ihr eingereichten Aufträge für Bundesschatzbriefe und Finanzierungsschätze gleichtägig über XONTRO ab. In den Abrechnungen sind die den Kreditinstituten gewährten Verkaufsvergütungen berücksichtigt. Die Abrechnungsbeträge werden usancegemäß am zweiten Geschäftstag nach dem Geschäftsabschlussstag (Valutierungstag) dem Bundesbank-Girokonto des jeweiligen Kreditinstituts belastet. Bei Bundesschatzbriefen werden Stückzinsen bis einschließlich des Kalendertages vor dem Valutierungstag verrechnet, bei Finanzierungsschätzen werden die dem Käufer ab dem Valutierungstag zustehenden Zinsen vom Nennwert abgezogen. Am Valutierungstag erfolgt auch die Gutschrift der Werte auf dem Depotkonto des jeweiligen Kreditinstituts bei der Clearstream Banking AG Frankfurt.

3 Für die Abwicklung vorzeitiger Rückgaben von Bundesschatzbriefen zwischen den Kreditinstituten und den Hauptverwaltungen der Deutschen Bundesbank gilt Folgendes:

3.1 Kreditinstitute mit XONTRO-berechtigtem Konto bei der Clearstream Banking AG Frankfurt können vorzeitige Rückgaben von Bundesschatzbriefen für eine gleichtägige Abrechnung bis 13.00 Uhr der zuständigen Hauptverwaltung der Deutschen Bundesbank - je nach Vereinbarung mit deren Wertpapierabteilung - zur Abwicklung über XONTRO übermitteln oder die Rückgaben selbst über XONTRO abwickeln.

3.2 Kreditinstitute ohne eigenes XONTRO-berechtigtes Konto bei der Clearstream Banking AG Frankfurt wickeln die Rückgaben über ein anderes Kreditinstitut mit einem solchen Konto ab.

3.3 Der Gegenwert der Rückgaben wird usancegemäß am zweiten Geschäftstag nach dem Geschäftsabschlussstag (Valutierungstag) dem Bundesbank-Girokonto des jeweiligen Kreditinstituts gutgeschrieben. Dabei werden bei Bundesschatzbriefen Typ A Nennwert und Stückzinsen und bei Bundesschatzbriefen Typ B der Rückzahlungswert bis einschließlich des Kalendertages vor dem Valutierungstag vergütet.

Diese Mitteilung ersetzt mit Wirkung vom 2. Januar 2004 die Bekanntmachung der Deutschen Bundesbank vom 24. Januar 2003 (Bundesanzeiger Nr. 28 vom 11. Februar 2003).

DEUTSCHE BUNDESBANK