
ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

3. Abschnitt: Zum Handel zugelassene echte Pensionsgeschäfte

[...]

3.1 Special und GC Repo Segment

[...]

3.1.1 Spezifikationen für ein General Collateral Repo

[...]

3.1.1.1 Kontraktgegenstand

[...]

(5) [...]

Die Berechnung für alle vorstehend in Abs. (5) benannten Fälle erfolgt auf der Grundlage der Anzahl der tatsächlich abgelaufenen Kalendertage des Berechnungszeitraums dividiert durch die Zahl 360 („actual/360“) für EUR, ~~CHF und USD~~ und 365 („actual/365“) für GBP.

[...]

[...]

3.1.2 Spezifikationen für ein Special Repo

[...]

3.1.2.1 Kontraktgegenstand

[...]

(4) [...]

Die Berechnung erfolgt für alle vorstehend in Abs. (4) benannten Fälle auf der Grundlage der Anzahl der tatsächlich abgelaufenen Kalendertage des Berechnungszeitraums dividiert durch die Zahl 360 („actual/360“) für EUR, ~~CHF und USD~~ und 365 („actual/365“) für GBP.

[...]

[...]

3.2 GC Pooling Repo Segment

[...]

3.2.1 Spezifikationen für ein GC Pooling Repo auf einen GC Pooling ECB Basket Repo („GC Pooling ECB Basket Repo“)

[...]

3.2.1.1 Kontraktgegenstand

[...]

(6) Ein GC Pooling ECB Basket Repo muss einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens EUR (bzw. USD, CHF oder GBP) 1.000.000 (in Worten: Eine Million) aufweisen. Zusätzlich muss ein GC Pooling ECB Basket Repo einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens DKK (bzw. NOK oder SEK) 10.000.000 (in Worten: Zehn Millionen) aufweisen.

(7) [...]

Die Berechnung erfolgt für alle vorstehend in Abs. (7) benannten Fälle auf der Grundlage der Anzahl der tatsächlich abgelaufenen Kalendertage des Berechnungszeitraums dividiert durch die Zahl 360 („actual/360“) für EUR, CHF, ~~und~~ USD, DKK, NOK und SEK und 365 („actual/365“) für GBP.

[...]

[...]

3.2.2 Spezifikationen für ein GC Pooling Repo auf einen GC Pooling ECB EXTendedBasket Repo („GC Pooling ECB EXT. Basket Repo“)

[...]

3.2.2.1 Kontraktgegenstand

[...]

- (6) Ein GC Pooling ECB EXT. Basket Repo muss einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens EUR (bzw. USD, CHF oder GBP) 1.000.000 (in Worten: Eine Million) aufweisen. Zusätzlich muss ein GC Pooling ECB EXT. Basket Repo einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens DKK (bzw. NOK oder SEK) 10.000.000 (in Worten: Zehn Millionen) aufweisen.

[...]

3.2.3 Spezifikationen für ein GC Pooling Repo auf einen GC Pooling International Maximum Quality Basket Repo („GC Pooling INT MXQ Basket Repo“)

[...]

3.2.3.1 Kontraktgegenstand

[...]

- (6) Ein GC Pooling INT MXQ Basket Repo muss einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens EUR (bzw. USD, CHF oder GBP) 1.000.000 (in Worten: Eine Million) aufweisen. Zusätzlich muss ein GC Pooling INT MXQ Basket Repo einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens DKK (bzw. NOK oder SEK) 10.000.000 (in Worten: Zehn Millionen) aufweisen.

[...]

3.2.4 Spezifikationen für ein GC Pooling Repo auf einen GC Pooling Single Issuer Basket Repo („GC Pooling Single Issuer Basket Repo“)

[...]

3.2.4.1 Kontraktgegenstand

[...]

- (6) Ein GC Pooling Single Issuer Basket Repo muss einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens EUR (bzw. USD, CHF oder GBP) 1.000.000 (in Worten: Eine Million) aufweisen. Zusätzlich muss ein GC Pooling Single Issuer Basket Repo einen Geldbetrag (cash amount) von mindestens DKK (bzw. NOK oder SEK) 10.000.000 (in Worten: Zehn Millionen) aufweisen.

[...]

3.3 Select Invest

[...]

3.3.1 Select Invest Repos

[...]

- (3) Näheres zu den für einen Select Invest Repo zulässigen und in den jeweiligen Baskets einbezogenen Wertpapieren wird in den Basketspezifikationen geregelt. Die für die jeweiligen Baskets zulässigen Handelswährungen sind EUR, USD, CHF, ~~und~~ GBP, DKK, NOK und SEK.

[...]

6. Abschnitt: Schlussbestimmungen

6.1 Entgelte

[...]

6.1.2 Segmentübergreifende transaktionsbezogene Entgelte zwischen Teilnehmern mit der Handelsfunktionalität Quote

[...]

Entgeltgruppe	Liquidity Taker		Liquidity Provider II		Liquidity Provider I	
Handels-funktionalität	Quote	Andere ¹	Quote	Andere ¹	Quote	Andere ¹
[...]						
Mindestentgelt pro Repo Geschäft je Währung	EUR 10 / CHF 12 / GBP 8 / USD 14 / <u>DKK 75 / NOK 110 / SEK 110</u>		EUR 5 / CHF 6 / GBP 4 / USD 7 / <u>DKK 35 / NOK 55 / SEK 55</u>		-	
[...]						

[...]

6.1.3 Segmentübergreifende transaktionsbezogene Entgelte für Transaktionen mit Teilnehmern ohne die Handelsfunktionalität Quote

[...]

	GC Pooling Repo Segment	Special und GC Repo Segment	Select Invest Repo
Entgeltsatz in Basispunkten p. a	1,2	0,6	1,5
Mindestentgelt pro Repo Geschäft je Währung	Entsprechend der Entgeltgruppe gemäß Ziffer 6.1.2		[...] / USD 35 / <u>DKK 190 / NOK 280 /</u> <u>SEK 280</u>

[...]

* * * * *