****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

EINFÜGUNGEN SIND UNTERSTRICHEN;

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

3. GC Pooling® Repo Segment

[…]

3.2 Baskets für GC Pooling Repo

3.2.1 GC Pooling ECB Basket

3.2.1.1 Zugelassene Wertpapiere

[…]

Zulässige Handelswährungen für den GC Pooling ECB Basket sind EUR, USD, CHF, ~~und~~ GBP, DKK, NOK und SEK.

[…]

[…]

3.2.2 GC Pooling ECB EXTended Basket („GC Pooling ECB EXT. Basket“)

3.2.2.1 Zugelassene Wertpapiere

[…]

Zulässige Handelswährungen für den GC Pooling ECB EXT. Basket Repo sind EUR, USD, CHF, ~~und~~ GBP, DKK, NOK und SEK.

[…]

[…]

3.2.3 GC Pooling International Maximum Quality Basket („GC Pooling INT MXQ Basket“)

[…]

Zulässige Handelswährungen für den GC Pooling INT MXQ Basket Repo sind EUR, USD, CHF, ~~und~~ GBP, DKK, NOK und SEK.

[…]

3.2.4 GC Pooling Single Issuer Basket („GC Pooling Single Issuer Basket“)

Der GC Pooling Single Issuer Basket beinhaltet für die Besicherung zugelassene Wertpapiere, welche durch die Eurex Frankfurt AG als „Cheapest to deliver“ (CTD) für die Belieferung von Fixed Income Futures-Kontrakten an den vier Verfallsterminen der Futures-Kontrakte (März, Juni, September und Dezember) in Frage kommen. Zulässige Handelswährung für den GC Pooling Single Issuer Basket Repo ist EUR, USD, CHF, GBP, DKK, NOK und SEK.

[…]

3.2.4.1 GC Pooling Germany Basket

Der GC Pooling Germany Basket beinhaltet für die Besicherung zugelassene deutsche Staatsanleihen mit einer Laufzeit bis zu 35 Jahren und einem Mindestemissionsvolumen von 250 Millionen Euro. Darunter befinden sich Wertpapiere, welche durch die Eurex Frankfurt AG als „Cheapest to deliver“ für die Belieferung von Fixed Income Futures-Kontrakten an den vier Verfallsterminen der Futures-Kontrakte (März, Juni, September und Dezember) in Frage kommen. ~~Zulässige Handelswährungen für den GC Pooling Germany Basket Repo sind EUR, CHF, GBP und USD.~~

3.2.4.2 GC Pooling France Basket

Der GC Pooling France Basket beinhaltet für die Besicherung zugelassene französische Staatsanleihen mit einer Laufzeit bis zu 15 Jahren und einem Mindestemissionsvolumen von 250 Millionen Euro. Darunter befinden sich Wertpapiere, welche durch die Eurex Frankfurt AG als „Cheapest to deliver“ für die Belieferung von Fixed Income Futures-Kontrakten an den vier Verfallsterminen der Futures-Kontrakte (März, Juni, September und Dezember) in Frage kommen. ~~Zulässige Handelswährungen für den GC Pooling France Basket Repo sind EUR, CHF, GBP und USD.~~

3.2.4.3 GC Pooling Italy Basket

Der GC Pooling Italy Basket beinhaltet für die Besicherung zugelassene italienische Staatsanleihen mit einer Laufzeit bis zu 15 Jahren und einem Mindestemissionsvolumen von

250 Millionen Euro. Darunter befinden sich Wertpapiere, welche durch die Eurex Frankfurt AG als „Cheapest to deliver“ für die Belieferung von Fixed Income Futures-Kontrakten an den vier Verfallsterminen der Futures-Kontrakte (März, Juni, September und Dezember) in Frage kommen. ~~Zulässige Handelswährungen für den GC Pooling Italy Basket Repo sind EUR, CHF, GBP und USD.~~

3.2.4.4 GC Pooling Spain Basket

Der GC Pooling Spain Basket beinhaltet für die Besicherung zugelassene spanische Staatsanleihen mit einer Laufzeit bis zu 15 Jahren und einem Mindestemissionsvolumen von 250 Millionen Euro. Darunter befinden sich Wertpapiere, welche durch die Eurex Frankfurt AG als „Cheapest to deliver“ für die Belieferung von Fixed Income Futures-Kontrakten an den vier Verfallsterminen der Futures-Kontrakte (März, Juni, September und Dezember) in Frage kommen. ~~Zulässige Handelswährung für den GC Pooling Spain Basket Repo sind EUR, CHF, GBP und USD.~~

3.2.4.5 GC Pooling EU Basket

Der GC Pooling EU Basket beinhaltet für die Besicherung zugelassene Anleihen, emittiert von der Europäischen Union, mit einer Laufzeit bis zu 15 Jahren und einem Mindestemissionsvolumen von 250 Millionen Euro. Darunter befinden sich Wertpapiere, welche durch die Eurex Frankfurt AG als „Cheapest to deliver“ für die Belieferung von Fixed Income Futures-Kontrakten an den vier Verfallsterminen der Futures-Kontrakte (März, Juni, September und Dezember) in Frage kommen. ~~Zulässige Handelswährung für den GC Pooling EU Basket Repo sind EUR, CHF, GBP und USD.~~

[…]

3.3 Laufzeiten im GC Pooling Repo Segment

[…]

Das letztmögliche Enddatum eines GC Pooling Repos der Laufzeitgruppe Open-Repo-Geschäft ist der letzte Handelstag innerhalb der nächsten 1095 Kalendertage nach dem Tag des Geschäftsabschlusses des GC Pooling Repos und kann während der Laufzeit und auch als Partial Return oder Partial Recall

[…]

~~Für USD GC Pooling werden keine Open Laufzeiten bereitgestellt.~~

[…]

3.3.1 Standardlaufzeiten

[…]

„**Tom 1W**“, „**Tom 2W**“, „**Tom 3W**“ bezeichnen die Laufzeiten eines Repo-Geschäftes, bei dem das Anfangsdatum für das Front-Leg dem Abschlusstag zuzüglich eines Handelstages entspricht und das Enddatum für das Term-Leg sieben (1W), vierzehn (2W) oder einundzwanzig (3W) Kalendertage nach dem Anfangsdatum liegt. Entspricht das ~~so~~ ermittelte Enddatum einem Kalendertag, der nicht ein Handelstag ist, so ist der nächstmögliche Handelstag das jeweilige Enddatum.

[…]

[…]

3.4 Handelszeiten

[…]

Trade Type	Currency	Trading Times				
		Non-SameDay settling trade terms		**SameDay** settling trade terms (e.g. Overnight)		
		Start	End	Start	End	End for Select Invest
GC Pooling [5]	EUR	07:30	18:00	07:30	17:00 [2] 16:00 [3] 15:30 [4]	14:30
	USD	07:30	18:00	07:30	15:30	15:30
	CHF	07:30	18:00	07:30	~~13:00~~14:40	13:30
	GBP	07:30	18:00	07:30	16:45~~30~~	15:30
	DKK	07:30	18:00	07:30	13:00	12:15
	NOK	07:30	18:00	07:30	13:30	12:45
	SEK	07:30	18:00	07:30	13:30	12:45

Early Morning[1]	EUR	07:30	18:00	N/A	N/A	N/A

[…]

5 Sofern in der Tabelle nicht anderweitig angegeben, sind ~~D~~die Handelszeiten für das Select Invest Segment sind 07:30-18:00 Uhr Ortszeit Frankfurt am Main. ~~Handelsende für Select Invest Transaktionen mit gleichtägiger Abwicklung ist 14:30 Uhr Ortszeit Frankfurt am Main für die Währung EUR, 15:30 Uhr Ortszeit Frankfurt am Main für die Währung USD, 13:30 Uhr Ortszeit Frankfurt am Main für die Währung CHF und 15:30 Uhr Ortszeit Frankfurt am Main für die Währung GBP.~~ Abweichende Handelszeiten für Select Invest Transaktionen mit gleichtägiger Abwicklung gelten für Select Invest Teilnehmer, die sich für das Verfahren zum frühen Cash Sweep gemäß Ziffer 3.3.3 Absatz 4 der Geschäftsbedingungen entschieden haben. Diese Zeiten werden auf der Internetseite der Eurex Repo GmbH veröffentlicht.

* * * * *