



FÉDÉRATION BANCAIRE DE L'UNION EUROPÉENNE  
BANKING FEDERATION OF THE EUROPEAN UNION  
BANKENVEREINIGUNG DER EUROPÄISCHEN UNION

in co-operation with



EUROPEAN SAVINGS BANKS GROUP  
GROUPEMENT EUROPEEN DES CAISSES D'ÉPARGNE  
EUROPÄISCHE SPARKASSENVEREINIGUNG



EUROPEAN ASSOCIATION OF COOPERATIVE BANKS  
GROUPEMENT EUROPEEN DES BANQUES COOPERATIVES  
EUROPÄISCHE VEREINIGUNG DER GENOSSENSCHAFTSBANKEN

## CONVENTION-CADRE RELATIVE AUX OPERATIONS SUR INSTRUMENTS FINANCIERS

### INDEX DES DEFINITIONS

Edition 2004

Le présent Index des Définitions énonce les documents et sections dans lesquels sont définis les termes énumérés ci-dessous.

L'utilisation dans le présent Index des Définitions de :

DP signifie Dispositions Particulières,

DG signifie Dispositions Générales,

PL signifie Annexe de Produit Relative aux Opérations de Pension Livrée,

PT signifie Annexe de Produit Relative aux Opérations de Prêts de Titres,

IFT signifie Annexe de Produit Relative aux Opérations sur Instruments Financiers à Terme,

GM signifie Annexe Relative à la Gestion des Marges,

AC signifie Additif Relatif aux Opérations de Change,

ATI signifie Additif Relatif aux Opérations sur Taux d'Intérêt,

AO signifie Additif Relatif aux Opérations d'Option.

Les chiffres qui ne sont pas entre parenthèses font référence aux sections du document correspondant ; les chiffres et les lettres qui sont entre parenthèses font référence à des sous sections et paragraphes.

**A.**

Accord de Taux Futur ou ATF ATI 2  
Acheteur AO 1(1) ; AC 2 ; ATI 2  
Actif Sous-Jacent AO 1(1)(a)  
Actifs de Substitution DG 3(2)(b)  
Additif Change AC 1(1)  
Additif Options AO 1(1)  
Additif Taux d'Intérêt ATI 1(1)  
Agent de Calcul IFT 4  
Agent de Domiciliation DG 11(3)  
Agent de Valorisation GM 1(2)  
Annexe DP 1 ; DG 1(2)  
Annexe Instruments Financiers à Terme IFT 1(1)  
Annexe Pension Livrée PL 1(1)  
Annexe Prêt de Titres PT 1(1)  
Annexes Produit DG 1(2)  
Aucun Ajustement ATI 4(11)  
Autorité Compétente DG 6(1)(a)(viii)(3)

**B.**

Base de Calcul (Base 1/1 ; Base Exact/360 ; Base 30E/360 ; Base 30/360 ; Base 360/360 (Convention-Cadre Allemande) ; Base Exact/365 ; Base Exact/365 Fixe ; Base 365/365 (Convention-Cadre Allemande) ; Base Exact/ Exact (Convention-Cadre AFB/FBF)) ATI 4(7)  
Barrière AO 4(5)  
Bourse IFT 4

**C.**

Capitalisation ATI 4(2)  
Capitalisation Linéaire ATI 4(2)  
Cas de Défaut DG 6(1)(a)  
Cédant PL 1(1)  
Cessionnaire PL 1(1)  
Circonstance Nouvelle DG 6(2)(a)  
Coefficient de Pondération GM1(1)  
Commission de Prêt PT 4  
Confirmation DG 2(2)  
Convention DG 1(2)  
Convention-Cadre DG 1(1) ; DP 1  
Convention de Dérèglement du Marché IFT 4  
Convention Eurodollar ATI 4(11)  
Couple de Devises AC 3(5)  
Coupon Couru PL 5(1)  
Coût d'Achat Alternatif PL 2(6)(b)(iii)  
Coût d'Acquisition PT 2(5)(b)(ii)  
Coût d'Emprunt PL 2(6)(a)(ii)  
Coût d'Emprunt Alternatif PT 2(5)(a)(i)  
Créance de Restitution de Marge DG 7(1)(a)  
Créances Reconventionnelles DG 7(4)

**D.**

Date d'Echéance IFT 4 ; AO 2(3)  
Date d'Evaluation IFT 4 ; AO 5(2)  
Date d'Exercice AO 5(2)  
Date d'Exercice Prévue AO 2(1)  
Date de Capitalisation ATI 4(2)  
Date de Cession PL 2(1)  
Date de Commencement AO 2(3)  
Date de Conclusion IFT 4  
Date de Constatation AO 2(3)  
Date de Cotation DG 7(1)(a)  
Date de Détermination ATI 4(5)

Date de Fin de Période ATI 4(11)  
Date de Livraison PT 2(1)  
Date de Modification du Prix PL 6(2)(a)  
Date de Paiement de la Prime AO 3  
Date de Règlement IFT 4 ; ATI 4(12)  
Date de Résiliation DG 6(1)(b) ; DG 6(2)(b)  
Date de Restitution PT 2(2)  
Date de Rétrocession PL 2(2)  
Date de Valorisation GM 1(3)  
Date Effective IFT 4  
De même nature DG 3(2)(b)  
Dérèglement de la Source de Prix ATI 4(9)  
Dérèglement du Marché IFT 4  
Devise Contractuelle DG 3(1)  
Devise d'Achat AC 2  
Devise de Paiement du Différentiel IFT 4  
Devise de Référence DG 7(1)(b) ; AC 2  
Devise de Règlement AC 2  
Devise de Vente AC 2  
Différentiel AO 5(1) ; AC 3(4)  
Différentiel de Prix PL 2(3)  
Dispositions Générales DG 1(1) ; DP 1  
Dispositions Particulières DG 1(2) ; DP 1  
Distribution PL 2(7)(i) ; PT 2(6)(i)  
Documentation de Marché Standard IFT 2  
Droit de Timbre DG 4(2)

**E.**

Emprunteur PT 1(1)  
Engagements GM 1(3)  
EONIA (Euro Overnight Index Average Rate) DG 3(5)  
Equivalent PL 2(3) ; PT 2(3)  
Evénement Activant AO 4(5)  
Evénement Désactivant AO 4(5)  
Exercice Automatique AO 4(4)  
Exercice Multiple AO 4(7)  
Exercice Partiel AO4(6)

**F.**

FBE DG 1(1)  
Fournisseur de Marge GM 1(1)

**G.**

Garant DG 5(2)  
Garantie DG 5(2)  
Garantie de Taux Plafond ATI 2  
Garantie de Taux Plancher ATI 2  
Garantie Spécifique GM 1(1)

**H.**

Haircut GM 1(3)  
Heure d'Evaluation IFT 4  
Heure Limite d'Exercice AO 4(2)

**I.**

Impossibilité DG 6(2)(a)(ii)  
Introduite (Procédure Collective) DG 6(1)(a)(viii)

**J.**

Jour d'Exercice AO 2(3)  
Jour de Bourse IFT 4  
Jour Ouvré DG 3(7)  
Jour Ouvré Précédent DG 3(6)(a)  
Jour Ouvré Suivant DG 3(6)(b)  
Jour Ouvré Suivant Sauf Mois Suivant DG 3(6)(c)  
Jugement d'Ouverture DG 6(1)(a)(viii)

**L.**

Lieu de Domiciliation DG 9(3)  
Livraison AO 1(1)(a)(i) ; AO 1(1)(c)(i) ; AC 2 ; ATI 2

**M.**

Mandant DG 10(10)(a)  
Mandataire DG 10(10)(a)  
Marge GM 1(3)  
Marge en Espèces GM 1(1)  
Marge en Titres GM 1(1)  
Méthode de Paiement du Différentiel AO 5(1)  
Mesure de Référence AO 1(1)(b)  
Montant Capitalisé ATI 4(2)  
Montant Capitalisé Additionnel ATI 4(2)  
Montant Capitalisé de Base ATI 4(2)  
Montant Capitalisé Linéairement ATI 4(2)  
Montant de Devise de Règlement AC 3(2)  
Montant de Référence ATI 4(3)  
Montant de Référence Ajusté ATI 4(2)  
Montant Minimum de Transfert GM 2(6)  
Montant Notionnel ATI 2  
Montant Notionnel de Devise ATI 2  
Montants Dus DG 7(1)(a)  
Montants Fixes ATI 2  
Montants Variables ATI 2  
Moyenne Pondérée ATI 4(5)  
Multiple AO 4(6)

**N.**

Niveau d'Exercice AO 1(1)(b)  
Niveau de Règlement AO 1(1)(b)  
Nombre d'Options Exercées AO 4(6)  
Nombre d'Options Non-Exercées AO4(4)  
Nombre Maximum d'Options Exerçables AO 4(7)  
Nombre Minimum d'Options Exerçables AO 4(6)  
Notification d'Exercice AO 4(1)  
Nouveaux Titres PL 3(1)  
Nouvelle Entité DG 6(1)(a)(vii)  
Nouvelle Opération PL 6(2)(b)

**O.**

Opération DG 1(1)  
Opération d'Echange de Conditions d'Intérêt ATI (2)  
Opération d'Echange de Devises ATI (2)  
Opération de Change à Terme AC 2  
Opération de Change à Terme ne Donnant pas Lieu à Livraison AC 2  
Opération de Change au Comptant AC 2  
Opération Initiale PL 6(2)  
Opération Sous-Jacente AO 1(1)(c) ; ATI 2  
Opération Sous Mandat DG 10(10)(a)

Opérations d'Achat/Revente PL 5(1)  
Opérations d'Option AO 1(1)  
Opérations de Change AC 1(1)  
Opérations Déterminées DG 6(1)(a)(v)  
Opérations sur Instruments Financiers à Terme IFT 1(1)  
Opérations sur Taux d'Intérêt ATI 1(1)  
Option AO 1(1)  
Option Américaine AO 2(1)  
Option Asiatique AO 2(1)  
Option Bermudienne AO 2(1)  
Option d'Achat AO 2(2)  
Option de Change AC 2  
Option de Change Exécutée par Livraison AC 2  
Option de Change Exécutée par Paiement du Différentiel AC 2  
Option de Change ne Donnant pas Lieu à Livraison AC 2  
Option de Taux de Change AC 3(5)  
Option de Taux Variable ATI 4(5)  
Option de Vente AO 2(2)  
Option Européenne AO 2(1)  
Option sur Echange de Conditions d'Intérêt ATI 2  
Option sur Echange de Conditions d'Intérêt Exécutée par Livraison ATI 2  
Option sur Echange de Conditions d'Intérêt Exécutée par Paiement du Différentiel ATI 2

**P.**

Paiement du Différentiel AO 1(1)(a)(ii) ; AO 1(1)(c)(ii) ; AC 2 ; ATI 2  
Paiement Anticipé ATI 4(12)  
Paiement Différé ATI 4(12)  
Partie Affectée DG 6(2)(b)  
Partie Défaillante DG 6(1)(b)  
Partie en Charge des Calculs DG 7(1)(a)  
Partie Non Affectée DG 6(2)(b)  
Partie Non Défaillante DG 6(1)(b)  
Payeur des Montants Fixes ATI 3(1)  
Payeur des Montants Variables ATI 3(1)  
Pays Désigné DG 6(1)(a)(viii)  
Pensions PL 1(1)  
Période d'Application ATI 4(11)  
Période d'Exercice AO 4(2)  
Période de Capitalisation ATI 4(2)  
Première Heure d'Exercice AO 4(2)  
Prêteur PT 1(1)  
Prêts de Titres PT 1(1)  
Prime AO 1(1)  
Prix à Terme PL 5(1)  
Prix d'Exercice AO 1(1)(a) ; AC 3(5)  
Prix de Cession PL 1(1)  
Prix de Règlement AO 1(1)(a)(ii)  
Prix de Rétrocession PL 2(3)  
Prix de Revente PL 5(1)  
Prix Net PL 5(1)  
Procédure Collective DG 6(1)(a)(viii)  
Procédures DG 11(2)

**R.**

Ratio de Marge GM 1(3)  
Receveur de Marge GM 1(1)  
Restructuration Sociale DG 6(1)(a)(vii)  
Risque Net GM 1(3)  
Risque Net Ajusté GM 1(1)

**S.**

Seuil de Défaut DG 6(1)(a)(vi)  
Seuil de Risque GM 2(6)  
Siège du Vendeur AO 4(1)  
Simultané PL 2(3) ; IFT 4  
Solde de Résiliation DG 7(1)(a)  
Solde de Résiliation Potentiel GM 1(3)  
Source de Prix AC 3(5) ; ATI 4(5)  
Source de Prix Alternative ATI 4(9)

**T.**

Taux de Change Applicable DG 7(1)(b)  
Taux de Change à Terme AC 3(5)  
Taux de Change de Règlement AC 3(5)  
Taux de Défaut DG 3(5)  
Taux de la Pension PL 2(3)  
Taux d'Intérêt de Règlement ATI 4(5)  
Taux Fixe ATI 4(4)  
Taux Interbancaire DG 3(5)  
Taux Variable ATI 4(5)  
TEMPE (taux moyen pondéré en euros) DG 3(5)  
Titres DG 3(2)(a)  
Titres Cédés PL 2(1)  
Titres Prêtés PT 1(1)

**V.**

Valeur de Défaut DG 7(1)(a)  
Valeur de l'Opération DG 7(1)(a)  
Valeur de Marché DG 3(8) ; GM 1(1)  
Vendeur AO 1(1) ; AC 2 ; ATI 2