



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

in co-operation with



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



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

CONTRATTO QUADRO PER LE OPERAZIONI FINANZIARIE

INDICE DEI TERMINI DEFINITI Edizione 2004

Il presente indice specifica i documenti e le sezioni in cui si trovano le definizioni dei termini riportati di seguito.

Nel presente indice,

DS indica le Disposizioni Speciali,

DG indica le Disposizioni Generali,

REPO indica l'Allegato Prodotto per le Operazioni Pronti contro Termine,

PT indica l'Allegato Prodotto per le Operazioni di Prestito Titoli,

D indica l'Allegato Prodotto per Operazioni Derivate,

AMM indica l'Allegato Mantenimento del Margine,

STI indica il Supplemento all'Allegato Derivati - Operazioni su Tassi d'Interesse,

SOV indica il Supplemento all'Allegato Derivati - Operazioni Valutarie

SO indica il Supplemento all'Allegato Derivati - Opzioni.

I numeri non tra parentesi si riferiscono alle sezioni del relativo documento; i numeri e lettere tra parentesi si riferiscono alle sottosezioni e ai paragrafi.

A.

Acquirente REPO 1(1); SO 1(1); SOV 2; STI 2
Agente DG 10(10)a
Agente Calcolante D 4
Agente per la Notifica di Atti DG 11(3)
Agente per la Valorizzazione AMM 1(2)
Allegato DS (1); DG 1(2)
Allegato Derivati D 1(1)
Allegato Prestito Titoli PT 1(1)
Allegato Prodotto DG 1(2)
Allegato Riacquisto REPO 1(1)
Ammontare Minimo di Trasferimento AMM 2(6)
Attività Sostitutive DG 3(2)(b)
Attività Sottostante SO 1(1)(a)
Autorità Competente DG 6(1)(a)(viii)(3)

B.

Barriera SO 4(5)
Borsa D 4

C.

Capitalizzazione STI 4(2)
Capitalizzazione Fissa STI 4(2)
Cap sui Tassi di Interesse STI 2
Caso di Impossibilità DG 6(2)(a)(ii)
Caso di Inadempimento DG 6(1)(a)
Caso di *Knock-in* SO 4(5)
Caso di *Knock-out* SO 4(5)
Caso di Turbativa della Fonte di Prezzo STI 4(9)
Caso di Turbativa del Mercato D 4
Commissione di Prestito PT 4
Committente DG 10(10)(a)
Comunicazione di Esercizio SO 4(1)
Concomitante REPO 2(3); D 4
Conferma DG 2(2)
Contratto DG 1(2)
Contratto Differenziale su Tassi di Interesse o “CDTI” STI 2
Contratto Quadro DS 1; DG 1(1)
Convenzione in Eurodollari STI 4(11)
Convenzione sulla Turbativa del Mercato D 4
Corso di cambio a termine SOV 3(5)
Costo del Prestito REPO 2(6)(a)(ii)
Costo di Acquisizione PT 2(5)(b)(ii)
Costo di Acquisto Alternativo REPO 2(6)(b)(iii)
Costo di Prestito Alternativo PT 2(5)(a) (i)

D.

Data di Acquisto REPO 2(1)
Data di Capitalizzazione STI 4(2)
Data di Consegna PT 2(1)
Data di Contrattazione D 4
Data di Efficacia D 4
Data di Esercizio SO 5(2)
Data di Esercizio Fissata SO 2(1)
Data di Inizio SO 2(3)
Data di Pagamento del Premio SO 3
Data di Quotazione DG 7(1) (a)
Data di Regolamento D 4; STI 4(12)
Data di *Repricing* REPO 6(2)(a)
Data di Restituzione PT 2(2)

Data di Revisione del Tasso STI 4(5)
Data di Riacquisto REPO 2(2)
Data di Ripartizione Proporzionale SO 2(3)
Data di Risoluzione D 4
Data di Risoluzione Anticipata DG 6(1)(b); DG 6(2)(b)
Data di Scadenza SO 2(3)
Data di Valorizzazione AMM 1(3); D 4; SO 5(2)
Data Finale di Periodo STI 4(11)
Differenziale di Prezzo REPO 2(3)
Disposizioni Generali DS 1, DG 1(1)
Disposizioni Speciali DG 1(2), DS 1
Distribuzione REPO 2(7)(i); PT 2(6)(i)
Documentazione *Standard* di Mercato D 2

E.

Eccezioni DG 7(4)
Entità Successiva DG 6(1)(a)(vii)
EONIA DG 3(5)
Equivalentente REPO 2(3), PT 2(3)
Esercizio Automatico SO 4(4)
Esercizio Multiplo SO 4(7)
Esposizione Netta AAM 1(3)
Esposizione Netta Rettificata AMM 1(1)
Esercizio Parziale SO 4(6)

F.

FBE DG 1(1)
Floor sui Tassi di Interesse STI 2
Fonte di Prezzo SOV 3(5); STI 4(5)
Fonte di Prezzo Successiva STI 4(9)
Fornitore del Margine AMM 1(1)
Frazione di Calcolo Giornaliera (1/1; Effettivo/360; 30E/360; 30/360; 360/360 (*German Master*); Effettivo/365; Effettivo/Fisso 365; 365/365 (*German Master*); Effettivo/Effettivo (*Contratto Quadro AFB/BBF*) STI 4(7)

G.

Garante DG 5(2)
Garanzia DG 5(2)
Giorno Lavorativo DG 3(7)
Giorno Lavorativo di Borsa D 4
Giorno Lavorativo di Esercizio SO 2(3)
Giurisdizione Specificata DG 6(1)(a)(viii)

I.

Importi Insoluti DG 7(1)(a)
Imposta Documentale DG 4(2)
Inizio DG 6(1)(a)(viii)
Interesse Maturato REPO 5(1)

L.

Livello Base SO 1(1)(b)
Livello di Regolamento SO 1(1)(b)

M.

Margine AMM 1(3)
Margine in Contanti AMM 1(1)
Margine in Titoli AMM 1(1)
Media Ponderata STI 4(5)
Metodo di Regolamento in Contanti SO 5(1)

Misurazione Sottostante SO 1(1)(b)
Modificato, Successivo Modificato DG 3(6) (c)
Momento di Valorizzazione D 4
Multiplo Integrale SO 4(6)
Mutamento delle Circostanze DG 6(2)(a)

N.

Natura (“della stessa natura”) DG 3(2)(b)
Nessun Adeguamento STI 4(11)
Nuova Operazione REPO 6(2)(b)
Nuovi Titoli REPO 3(1)

O.

Operazione DG 1(1)
Operazione di Acquisto/Rivendita REPO 5(1)
Operazione di Agenzia DG 10(10)(a)
Operazione Sottostante SO 1(1)(c); STI 2
Operazione Valutaria *Spot* SOV 2
Operazioni Derivate D 1(1)
Operazioni di Riacquisto REPO 1(1)
Operazioni Originarie REPO 6(2)
Operazioni Specificate DG 6(1)(a)(v)
Operazioni sui Tassi di Interesse STI 1(1)
Operazioni Valutarie SOV 1(1)
Operazioni Valutarie *Forward* SOV 2
Operazioni Valutarie *Forward* Non-Standardizzate SOV 2
Opzione SO 1(1)
Opzione Americana SO 2(1)
Opzione Asiatica SO 2(1)
Opzione a Tasso Variabile STI 4(5)
Opzione Bermuda SO 2(1)
Opzione di Acquisto SO 2(2)
Opzione di Vendita SO 2(2)
Opzione Europea SO 2(1)
Opzione su *Swap* STI 2
Opzione su *Swap* Regolata a Pronti STI 2
Opzione su *Swap* Regolata in Contanti STI 2
Opzione Valutaria SOV 2
Opzione Valutaria Non-Standardizzata SOV 2
Opzione Valutaria Regolata a Pronti SOV 2
Opzione Valutaria Regolata in Contanti SOV 2
Opzione Valutaria sui Tassi di Interesse SOV 3(5)
Opzioni SO 1(1)
Orario di Esercizio Anticipato SO 4(2)

P.

Pagamento Anticipato STI 4(12)
Pagatore della Somma Fissa STI 3(1)
Pagatore della Somma Variabile STI 3(1)
Paio di Valute SOV 3(5)
Parte Calcolante DG 7(1)(a)
Parte Condizionata DG 6(2)(b)
Parte Inadempiente DG 6(1)(b)
Parte Non Condizionata DG 6(2)(b)
Parte Non Inadempiente DG 6(1)(b)
Passività AMM 1(3)
Percentuale di Valorizzazione AMM 1(1)
Periodo di Calcolo STI 4(11)
Periodo di Capitalizzazione STI 4(2)
Periodo di Esercizio SO 4(2)
Precedente DG 3(6)(a)

Premio SO 1(1)
Prenditore PT 1(1)
Prestatore PT 1(1)
Prestiti di Titoli PT 1(1)
Prezzo a Termine REPO 5(1)
Prezzo Base SO 1(1)(a); SOV 3(5)
Prezzo di Acquisto REPO 1(1)
Prezzo di Regolamento SO 1(1)(a)(ii)
Prezzo di Riacquisto REPO 2(3)
Prezzo di Rivendita REPO 5(1)
Prezzo Pulito REPO 5(1)
Procedimento DG 11(2)
Procedura Concorsuale DG 6(1)(a)(viii)

Q.

Quantità di Esercizio SO 4(6)
Quantità di Esercizio Massima SO 4(7)
Quantità di Esercizio Minima SO 4(6)
Quantità Non-Esercitata SO 4(4)

R.

Ratio di Margine AMM 1(3)
Regolamento in Contanti SO 1(1)(a)(ii); SO 1(1)(c)(ii); SOV 2; STI 2
Regolamento Materiale SO 1(1)(a)(i); SO 1(1)(c)(i); SOV 2; STI 2
Ricevente il Margine AMM 1(1)
Richiesta di Margine DG 7(1)(a)
Ristrutturazione Aziendale DG 6(1)(a)(vii)
Ritardo di Pagamento STI 4(12)

S.

Scarto di Garanzia AMM 1(3)
Sede del Venditore SO 4(1)
Sentenza Dichiarativa di Insolvenza DG 6(1)(a)(viii)
Soglia di Esposizione AMM 2(6)
Soglia di Inadempimento DG 6(1)(a)(vi)
Somma Definitiva di Regolamento DG 7(1) (a)
Somma Definitiva Potenziale di Regolamento AAM 1(3)
Somma della Valuta di Regolamento SOV 3(2)
Somma del Periodo di Capitalizzazione STI 4(2)
Somma del Periodo di Capitalizzazione Aggiuntiva STI 4(2)
Somma del Periodo di Capitalizzazione di Base STI 4(2)
Somma di Calcolo STI 4(3)
Somma di Calcolo Adeguata STI 4(2)
Somma di Capitalizzazione Fissa STI 4(2)
Somma di Regolamento in Contanti SO 5(1); SOV 3(4)
Somma Figurativa STI 2
Somma Indipendente AMM 1(1)
Somma in Valuta STI 2
Somme Fisse STI 2
Somme Variabili STI 2
Successivo DG 3(6)(b)
Supplemento Operazioni Valutarie SOV 1(1)
Supplemento Opzioni SO 1(1)
Supplemento Tassi d'Interesse STI 1(1)
Swap su tassi di interesse STI 2
Swap su tassi di interesse a valute incrociate STI 2

T.

Tasso della Valuta di Regolamento SOV 3(5)
Tasso di Cambio Applicabile DG 7(1)(b)

Tasso di Inadempimento DG 3(5)
Tasso di Interesse Fisso STI 4(4)
Tasso di Interesse di Regolamento STI 4(5)
Tasso di Interesse Variabile STI 4(5)
Tasso di *Pricing* REPO 2(3)
Tasso Interbancario DG 3(5)
Titoli DG 3(2)(a)
Titoli Acquistati REPO 2(1)
Titoli Prestati PT 1(1)

U.

Ufficio Contabilizzante DG 9(3)
Ultimissimo Orario di Esercizio SO 4(2)

V.

Valore della Operazione DG 7(1)(a)
Valore di Inadempimento DG 7(1)(a)
Valore di Mercato DG 3(8); AMM 1(1)
Valuta Base DG 7(1)(b)
Valuta Contrattuale DG 3(1)
Valuta dell'Opzione di Acquisto, SOV 2
Valuta dell'Opzione di Vendita SOV 2
Valuta di Riferimento SOV 2
Valuta di Regolamento SOV 2
Valuta di Regolamento in Contanti D 4
Venditore REPO 1(1); SO 1(1); SOV 2; STI 2