



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

RAAMOVEREENKOMST VOOR FINANCIELE TRANSACTIES

LIJST VAN GEDEFINIEERDE TERMEN

Uitgave 2004

Deze lijst verwijst naar de documenten en afdelingen waarin de onderstaande termen worden gedefinieerd.

In deze lijst betekent

BB Bijzondere Bepalingen,

AB Algemene Bepalingen,

REPO Productbijlage voor Repo-transacties (Bijlage Repo-transacties),

BE Productbijlage voor Effectenleningen (Bijlage Effectenleningen),

BD Productbijlage voor Derivatentransacties (Bijlage Derivatentransacties),

BM Bijlage Dekkingsmargebeheer,

ART Appendix van de Bijlage Derivatentransacties - Rentetransacties,

AWT Appendix van de Bijlage Derivatentransacties - Wisseltransacties,

AOT Appendix van de Bijlage Derivatentransacties - Optitransacties.

Cijfers die niet tussen haakjes staan, verwijzen naar de afdelingen in het overeenstemmende document; cijfers en letters tussen haakjes verwijzen naar onderafdelingen en paragrafen

A.

Aankoopkost BE 2(5)(b)(ii)
 Aankoopmunt AWT 2
 Agent AB 10(10)(a)
 Agententransactie AB 10(10)(a)
 Algemene Bepalingen BB 1; AB 1(1)
 Alternatieve Aankoopkosten REPO 2(6)(b)(iii)
 Alternatieve Leningkosten BE 2(5)(a)(i)
 Alternatieve Prijsreferentie ART 4(9)
 Amerikaanse Optie AOT 2(1)
 Appendix AB 1(2)
 Appendix Optietransacties AOT 1(1)
 Appendix Rentetransacties ART 1(1)
 Appendix Wisseltransacties AWT 1(1)
 Automatische Uitoefening AOT 4(4)
 Autonoom Bedrag BM 1(1)
 Aziatische Optie AOT 2(1)

B.

Bedrag ingevolge Flat Compounding ART 4(2)
 Bedrag in de Vereffeningmunt AWT 3(2)
 Begindatum AOT 2(3)
 Berekeningsagent BD 4
 Berekeningsbedrag ART 4(3)
 Berekeningspartij AB 7(1)(a)
 Berekeningsperiode ART 4(11)
 Bermuda-optie AOT 2(1)
 Beurs BD 4
 Beurswerkdag BD 4
 Bevestiging AB 2(2)
 Bevoegde Overheid AB 6(1)(a)(viii)(3)
 Bijlage BB 1; AB 1(2)
 Bijlage Derivatentransacties BD 1(1)
 Bijlage Effectenleningen BE 1(1)
 Bijlage Repo-transacties REPO 1(1)
 Bijzondere Bepalingen AB 1(2); BB 1
 Buy/Sell Back Transacties REPO 5(1)

C.

Call AOT 2(2)
 Cedent REPO 1(1)
 Cessiedatum REPO 2(1)
 Cessieprijs REPO 1(1)
 Cessionaris REPO 1(1)
 Clean Price REPO 5(1)
 Contante Vereffening AOT 1(1)(a)(ii); AOT 1(1)(c)(ii); AWT 2; ART 2
 Contant Vereffende Foreign Exchange Option AWT 2
 Contant Vereffende Interest Rate Swaption ART 2
 Contant Vereffeningbedrag AOT 5(1); AWT 3(4); ART3(5)
 Contractuele Munt AB 3(1)
 Cross Currency Rate Swap ART 2

D.

Datum van Prijsopgave AB 7(1)(a)
 Datum van Vervroegde Ontbinding AB 6(1)(b); AB 6(2)(b)
 Debiteur van het Variabel Bedrag ART 3(1)
 Debiteur van het Vast Bedrag ART 3(1)
 Dekkingsmarge BM 1(3)
 Dekkingsmarge in Effecten BM 1(1)
 Dekkingsmarge in Geld BM 1(1)
 Dekkingsmargeratio BM 1(3)
 Dekkingsmargevordering AB 7(1)(a)
 Derivatentransacties BD 1(1)
 Drempel AOT 4(5)
 Drempelwaarde voor Wanprestaties AB 6(1)(a)(vi)

E.

Effecten AB 3(2)(a)
 Effectenleningen BE 1(1)
 Einddatum BD 4
 Eindeperiodedatum ART 4(11)

EONIA AB 3(5)
 Equivalent REPO 2(3); BE 2(3)
 Eurodollar Convention ART 4(11)
 Europese Optie AOT 2(1)

F.

FBE AB 1(1)
 Floating Rate Option ART 4(5)
 Foreign Exchange Forward AWT 2
 Foreign Exchange Option AWT 2
 Foreign Exchange Spot AWT 2
 Forward Rate Agreement (FRA) ART 2
 Fysieke Vereffening AOT 1(1)(a)(i); AOT 1(1)(c)(i); AWT 2; ART 2
 Fysiek Vereffende Foreign Exchange Option AWT 2
 Fysiek Vereffende Interest Rate Swaption ART 2

G.

Garant AB 5(2)
 Garantie AB 5(2)
 Geceedeerde Effecten REPO 2(1)
 Gecorrigeerd Berekeningsbedrag ART 4(2)
 Gecorrigeerde Netto Risicopositie BM 1(1)
 Gedeeltelijke Uitoefening AOT 4(6)
 Geen Aanpassingen ART 4(11)
 Gekapitaliseerd Basisbedrag ART 4(2)
 Gekapitaliseerd Bedrag ART 4(2)
 Gekapitaliseerde Toeslag ART 4(2)
 Geldende Wisselkoers AB 7(1)(b)
 Gelijktijdig REPO 2(3); BD 4
 Gelopen Intresten REPO 5(1)
 Gemiddeldeberekeningsdatum AOT 2(3)
 Gestart AB 6 (1)(a)(viii)
 Getroffen Partij AB 6(2)(b)
 Geval van Wanprestatie AB 6(1)(a)
 Gewijzigde Omstandigheden AB 6(2)(a)
 Gewijzigde Werkdag, Gewijzigde Volgende Werkdag, AB 3(6)(c)
 Gewogen Gemiddelde ART 4(5)

H.

Haircut BM 1(3)

I.

Ingebrekebljvende Partij AB 6(1)(b)
 Insolventieprocedure AB 6(1)(a)(viii)
 Insolventverklaring AB 6(1)(a)(viii)
 Interbankrente AB 3(5)
 Interest Rate Cap ART 2
 Interest Rate Floor ART 2
 Interest Rate Swap ART 2
 Interest Rate Swaption ART 2
 Intrestberekeningsbasis (1/1; Actual/360; 30E/360; 30/360; 360/360 (Duitse Raamovereenkomst); Actual/365;
 Actual/Fixed 365; 365/365 (Duitse Raamovereenkomst); Actual/Actual (AFB/FBF Raamovereenkomst)) ART 4(7)

J.

Juridisch Vertegenwoordiger AB 11(3)

K.

Kantoor van de Verkoper AOT 4(1)
 Kapitalisatiedatum ART 4(2)
 Kapitalisatieperiode ART 4(2)
 Kennisgeving van Uitoefening AOT 4(1)
 Knock-in Event AOT 4(5)
 Knock-out Event AOT 4(5)
 Koper AOT 1(1); AWT 2; ART 2

L.

Laatste Uitoefentijdstip AOT 4(2)
 Lener BE 1(1)
 Leningkosten REPO 2(6)(a)(ii)
 Leningprovisie BE 4
 Leveringsdatum BE 2(1)

M.

Margebegunstigde BM 1(1)
 Margesteller BM 1(1)
 Marktstandaarddocumentatie BD 2
 Marktverstoring BD 4
 Marktverstoringsregeling BD 4
 Marktwaaarde AB 3(8); BM 1(1)
 Maximum Uitoefenvolume AOT 4(7)
 Meervoudige Uitoefening AOT 4(7)
 Methode voor Contante Vereffening AOT 5(1)
 Minimum Uitoefenvolume AOT 4(6)
 Minimumbedrag voor Overdracht BM 2(6)
 Muntenpaar AWT 3(5)
 Munt voor Contante Vereffening BD 4

N.

Netto Risicopositie BM 1(3)
 Niet-Getroffen Partij AB 6(2)(b)
 Niet-Ingebrekebleijvende Partij AB 6(l)(b)
 Niet-Uitgeoefend Volume AOT 4(4)
 Nieuwe Effecten REPO 3(1)
 Nieuwe Entiteit AB 6(1)(a)(vii)
 Nieuwe Transactie REPO 6(2)(b)
 Non-Deliverable Foreign Exchange Forward AWT 2
 Non-Deliverable Foreign Exchange Option AWT 2
 Notioneel Bedrag ART 2

O.

Onderliggende Activa AOT 1(1)(a)
 Onderliggende Parameter AOT 1(1)(b)
 Onderliggende Transactie AOT 1(1)(c); ART 2
 Ontlener BE 1(1)
 Oorspronkelijke Transacties REPO 6(2)
 Opdrachtgever AB 10(10)(a)
 Optie AOT 1(1)
 Optietransacties AOT 1(1)
 Overeenkomen Uitoefendatum AOT 2(1)
 Overeenkomst AB 1(2)
 Overmacht AB 6(2)(a)(ii)

P.

Potentieel Vereffeningssaldo BM 1(3)
 Premie AOT 1(1)
 Premiebetaaldatum AOT 3
 Prijsreferentie AWT 3(5); ART 4(5)
 Prijsreferentiestoring ART 4(9)
 Prijsverschil REPO 2(3)
 Prijswijzigingsdatum REPO 6(2)(a)
 Procedures AB 11(2)
 Productbijlagen AB 1(2)
 Put AOT 2(2)

Q.**R.**

Raamovereenkomst BB 1; AB 1(1)
 Referentiemunt AB 7(1)(b);
 Referentiemunt AWT 2
 Registratierecht AB 4(2)
 Relevante Vestiging AB 9(3)
 Rentetransacties ART 1(1)
 Reporente REPO 2(3)
 Repo-transacties REPO 1(1)
 Retrocessiedatum REPO 2(2)
 Retrocessieprijs REPO 2(3)
 Risicodrempel BM 2(6)

S.

Sell Back Price REPO 5(1)
 Copyright © 2004 FBE

Specifiek Rechtsgebied AB 6(1)(a)(viii)
 Specifieke Transacties AB 6(1)(a)(v)
 Startdatum BD 4
 Substitutie-activa AB 3(2)(b)

T.

Tegenvorderingen AB 7(4)
 Termijnprijs REPO 5(1)
 Termijnwisselkoers AWT 3(5)
 Teruggavedatum BE 2(2)
 Transactie AB 1(1)
 Transactiewaarde AB 7(1)(a)

U.

Uitgeleende Effecten BE 1(1)
 Uitgestelde Betaling ART 4(12)
 Uitkering REPO 2(7)(i); BE 2(6)(i)
 Uitoefendatum AOT 2(3)
 Uitoefenniveau AOT 1(1)(b)
 Uitoefenperiode AOT 4(2)
 Uitoefenprijs AOT 1(1)(a); AWT 3(5)
 Uitoefenvolume AOT 4(6)
 Uitoefenwerkdag AOT 2(3)

V.

Valutabedrag ART 2
 “van dezelfde aard” AB 3(2)(b)
 Variabele Bedragen ART 2
 Variabele Rente ART 4(5)
 Vaste Bedragen ART 2
 Vaste Rente ART 4(4)
 Vaststellingsdatum ART 4(5)
 Venootschapsherstructurering AB 6(1)(a)(vii)
 Vereffeningsdatum BD 4; ART 4(12)
 Vereffeningsmunt AWT 2
 Vereffeningsniveau AOT 1(1)(b)
 Vereffeningsprijs AOT 1(1)(a)(ii)
 Vereffeningsrentevoet ART 4(5)
 Vereffeningssaldo AB 7(1)(a)
 Vereffeningswisselkoers AWT 3(5)
 Verhandelingsdatum BD 4
 Verkoopmunt AWT 2
 Verkoper AOT 1(1); AWT 2; ART 2
 Verplichtingen BM 1(3)
 Verschuldigde Bedragen AB 7(1)(a)
 Vervaldatum AOT 2(3)
 Vervangingswaarde AB 7(1)(a)
 Vervroegde Betaling ART 4(12)
 Verwijlrentevoet AB 3(5)
 Volgende Werkdag AB 3(6)(b)
 Volledig Veelvoud AOT 4(6)
 Voorafgaande Werkdag AB 3(6)(a)
 Vroegste Uitoefentijdstip AOT 4(2)

W.

Waarderingsagent BM 1(2)
 Waarderingsdatum BM 1(3); BD 4; AOT 2(3)
 Waarderingsijdstip BD 4
 Wegingscoëfficiënt BM 1(1)
 Werkdag AB 3(7)
 Wisselkoersoptie AWT 3(5)
 Wisseltransacties AWT 2