



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

in Zusammenarbeit mit



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

RAHMENVERTRAG FÜR FINANZGESCHÄFTE

VERZEICHNIS DEFINIERTER BEGRIFFE

Ausgabe 2004

Dieses Verzeichnis gibt die Vertragsbestandteile und deren nummerierte Textabschnitte an, in denen die nachstehend aufgeführten Begriffe definiert sind.

Im Sinne dieses Verzeichnisses sind

- BB die Besonderen Bestimmungen,
- AB die Allgemeinen Bestimmungen,
- REPO der Produktanhang für Pensionsgeschäfte,
- WD der Produktanhang für Wertpapierdarlehen,
- D der Produktanhang für Derivategeschäfte,
- SI der Sicherheitenanhang,
- ZZ der Zusatz zum Derivateanhang – Zinsderivate,
- ZFX der Zusatz zum Derivateanhang – Devisengeschäfte,
- ZO der Zusatz zum Derivateanhang – Optionsgeschäfte.

Nicht in Klammern stehende Zahlenangaben sind Verweise auf nummerierte Textabschnitte des betreffenden Vertragsbestandteils; in Klammern stehende Zahlenangaben und Buchstaben sind Verweise auf Absätze und Unterabsätze.

A.	A.
Accrued Interest REPO 5(1)	Stückzinsen REPO 5(1)
Acquisition Cost SL 2(5)(b)(ii)	Erwerbskosten WD 2(5)(b)(ii)
Additional Compounding Period Amount SIR 4(2)	Zusätzlicher Aufzinsungsbetrag ZZ 4(2)
Adjusted Calculation Amount SIR 4(2)	Angepasster Berechnungsbetrag ZZ 4(2)
Adjusted Net Exposure MMA 1(1)	Angepasstes Nettoausfallrisiko SI 1(1)
Affected Party GP 6(2)(b)	Betroffene Partei AB 6(2)(b)
Agency Transaction GP 10(10)(a)	Vertretergeschäft AB 10(10)(a)
Agent GP 10(10)(a)	Vertreter AB (10)(10)(a)
Agreement GP 1(2)	Vertrag AB 1(2)
Alternative Borrowing Cost SL 2(5)(a)(i)	Ersatzdarlehenskosten WD 2(5)(a)(i)
Alternative Purchase Cost REPO 2(6)(b)(iii)	Ersatzerwerbskosten REPO 2(6)(b)(iii)
American Option SO 2(1)	Amerikanische Option ZO 2(1)
Amounts Due GP 7(1)(a)	Fällige Beträge AB 7(1)(a)
Annex SPI; GP1(2)	Anhang BBI, AB 1(2)
Applicable Exchange Rate GP 7(1)(b)	Anwendbarer Devisenkurs AB 7(1)(b)
Asian Option SO 2(1)	Asiatische Option ZO 2(1)
Automatic Exercise SO 4(4)	Automatische Ausübung ZO 4(4)
Averaging Date SO 2(3)	Durchschnittswertermittlungstag ZO 2(3)
B.	B.
Barrier SO 4(5)	Barriere ZO 4(5)
Base Currency GP 7(1)(b)	Basiswährung AB 7(1)(b)
Basic Compounding Period Amount SIR 4(2)	Basisaufzinsungsbetrag ZZ 4(2)
Bermuda Option SO 2(1)	Bermuda-Option ZO 2(1)
Booking Office GP 9(3)	Verbuchende Niederlassung AB 9(3)
Borrower SL 1(1)	Darlehensnehmer WD 1(1)
Borrowing Cost REPO 2(6)(a)(ii)	Wertpapierdarlehenskosten REPO 2(6)(a)(ii)
Business Day GP 3(7)	Geschäftstag AB 3(7)
Buyer REPO 1(1); SO 1(1); SFX 2; SIR 2	Käufer REPO 1(1), ZO 1(1), ZFX 2, ZZ 2
Buy/Sell Back Transactions REPO 5(1)	Kauf-/Rückverkaufsgeschäfte REPO 5(1)
C.	C.
Calculation Agent D 4	Berechnungsstelle D 4
Calculation Amount SIR 4(3)	Berechnungsbetrag ZZ 4(3)
Calculation Party GP 7(1)(a)	Berechnungspartei AB 7(1)(a)
Calculation Period SIR 4(11)	Berechnungszeitraum ZZ 4(11)
Call SO 2(2)	Kaufoption ZO 2(2)
Call Currency SFX 2	Kaufwährung ZFX 2
Cash Margin MMA 1(1)	Barsicherheit SI 1(1)
Cash Settled Foreign Exchange Option SFX 2	Devisenoption mit Barausgleich ZFX 2
Cash Settled Interest Rate Swaption SIR 2	Zins-Swaption mit Barausgleich ZZ 2
Cash Settlement SO 1(1)(a)(ii); SO 1(1)(c)(ii); SFX 2; SIR 2	Barausgleich ZO 1(1)(a)(ii); ZO 1(1)(c)(ii); ZFX 2; ZZ 2
Cash Settlement Amount SO 5(1); SFX 3(4)	Barausgleichsbetrag ZO 5(1); ZFX 3(4)
Cash Settlement Currency SO 5(1); SIR 3(5)	Barausgleichswährung ZO 5(1); ZZ 3(5)
Cash Settlement Method SO 5(1)	Barausgleichsmethode ZO 5(1)
Change of Circumstances GP 6(2)(a)	Änderung von Umständen AB 6(2)(a)
Clean Price REPO 5(1)	Nettokaufpreis REPO 5(1)
commence GP 6(1)(a)(viii)	einleiten AB 6(1)(a)(viii)
Commencement Date SO 2(3)	Startdatum ZO 2(3)
Competent Authority GP 6(1)(a)(viii)(3)	Zuständige Behörde AB 6(1)(a)(viii)(3)
Compounding SIR 4(2)	Compounding ZZ 4(2)
Compounding Date SIR 4(2)	Aufzinsungstermin ZZ 4(2)
Compounding Period SIR 4(2)	Aufzinsungszeitraum ZZ 4(2)
Compounding Period Amounts SIR 4(2)	Aufzinsungsbetrag ZZ 4(2)
Confirmation GP 2(2)	Bestätigung AB 2(2)
Contractual Currency GP 3(1)	Vertragswährung AB 3(1)

Corporate Restructuring GP 6(1)(a)(vii)	Umwandlung AB 6(1)(a)(vii)
Counterclaims GP 7(4)	Gegenansprüche AB 7(4)
Cross Currency Rate Swap SIR 2	Zinsswappingsswap SIR 2
Currency Amount SIR 2	Währungsbezugsbetrag ZZ 2
Currency Pair SFX 3(5)	Währungspaar ZFX 3(5)
Currency Rate Option SFX 3(5)	Abwicklungszinssatzoption ZFX 3(5)
D.	D.
Day Count Fraction (1/1; Actual/360; 30E/360; 30/360; 360/360 (German Master); Actual/365; Actual/Fixed 365; 365/365 (German Master); Actual/Actual (French Master)) SIR 4(7)	Zinstagequotient (1/1; Actual/360; 30E/360; 30/360; 360/360 (Deutscher Rahmenvertrag); Actual/365; Actual/Fixed 365; 365/365 (Deutscher Rahmenvertrag); Actual/Actual (AFB /FBF Master Agreement)) ZZ 4(7)
Default Rate GP 3(5)	Verzugssatz AB 3(5)
Default Threshold GP 6(1)(a)(vi)	Kündigungsschwelle AB 6(1)(a)(vi)
Default Value GP 7(1)(a)	Liquidationswert AB 7(1)(a)
Defaulting Party GP 6(1)(b)	Vertragsbrüchige Partei AB 6(1)(b)
Delayed Payment SIR 4(12)	Zahlungsaufschub ZZ 4(12)
Delivery Date SL 2(1)	Lieferdatum WD 2(1)
Derivative Transactions D 1(1)	Derivategeschäfte D 1(1)
Derivatives Annex D 1(1)	Derivateanhang D 1(1)
Distribution REPO 2(7)(i); SL 2(6)(i)	Ausschüttung REPO 2(7)(i), WD 2(6)(i)
Divisor SO 4(6)	Divisor ZO 4(6)
Documentary Tax GP 4(2)	Urkundensteuer AB 4(2)
E.	E.
Earliest Exercise Time SO 4(2)	Frühester Ausübungszeitpunkt ZO 4(2)
Early Payment SIR 4(12)	Vorzeitige Zahlung ZZ 4(12)
Early Termination Date GP 6(1)(b); GP 6(2)(b)	Vorzeitiger Beendigungstag AB 6(1)(b), AB 6(2)(b)
Effective Date D 4	Anfangsdatum D 4
EONIA GP 3(5)	EONIA AB 3(5)
Equivalent REPO 2(3); SL 2(3)	Entsprechende Anzahl REPO 2(3), WD 2(3)
Eurodollar Convention SIR 4(11)	Eurodollar-Konvention ZZ 4(11)
European Option SO 2(1)	Europäische Option ZO 2(1)
Event of Default GP 6(1)(a)	Kündigungsgrund AB 6(1)(a)
Exercise Business Day SO 2(3)	Ausübungsgeschäftstag ZO 2(3)
Exercise Date SO 2(3)	Ausübungstag ZO 2(3)
Exercise Notice SO 4(1)	Ausübungserklärung ZO 4(1)
Exercise Period SO 4(2)	Ausübungsfrist ZO 4(2)
Exercise Quantity SO 4(6)	Ausübungsbetrag ZO 4(6)
Expiration Date SO 2 (3)	Verfalltag ZO 2(3)
Exposure Threshold MMA 2(6)	Risikoschwelle SI 2(6)
F.	F
FBE GP 1(1)	FBE AB 1(1)
Final Settlement Amount GP 7(1)(a)	Abschlussbetrag AB 7(1)(a)
Fixed Amount Payer SIR 3(1)	Zahler des Festbetrags ZZ 3(1)
Fixed Amounts SIR 2	Festbeträge ZZ 2
Fixed Rate SIR 4(4)	Festzinssatz ZZ 4(4)
Flat Compounding SIR 4(2)	Flat Compounding ZZ 4(2)
Flat Compounding Amount SIR 4(2)	Nettoaufzinsungsbetrag ZZ 4(2)
Floating Amount Payer SIR 3(1)	Zahler des Variablen Betrags ZZ 3(1)
Floating Amounts SIR 2	Variable Beträge ZZ 2
Floating Rate SIR 4(5)	Variabler Zinssatz ZZ 4(5)
Floating Rate Option SIR 4(5)	Zinsbezugsgröße ZZ 4(5)
Following GP 3(6)(b)	Folgender AB 3(6)(b)
Foreign Exchange Forward SFX 2	Devisentermingeschäft ZFX 2
Foreign Exchange Option SFX 2	Devisenoption ZFX 2
Foreign Exchange Spot SFX 2	Devisenkassageschäft ZFX 2

Foreign Exchange Supplement SFX 1(1)	Devisen-Zusatz ZFX 1(1)
Forward Price REPO 5(1)	Terminpreis REPO 5(1)
Forward Rate SFX 3(5)	Terminkurs ZFX 3(5)
Forward Rate Agreement SIR 2	Forward Rate Agreement ZZ 2
G.	G.
General Provisions SP 1; GP 1(1)	Allgemeine Bestimmungen BB1, AB 1(1)
Guarantee GP 5(2)	Garantie AB 5(2)
Guarantor GP 5(2)	Garant AB 5(2)
H.	H.
Haircut MMA 1(3)	Haircut SI 1(3)
I.	I.
Impossibility Event GP 6(2)(a)(ii)	Hinderungsgründe AB 6(2)(a)(ii)
Independent Amount MMA 1(1)	Zusatzbetrag SI 1(1)
Insolvency Proceeding GP 6(1)(a)(viii)	Insolvenzverfahren AB 6(1)(a)(viii)
Interbank Rate GP 3(5)	Interbankensatz AB 3(5)
Interest Rate Cap SIR 2	Zins-Cap ZZ 2
Interest Rate Floor SIR 2	Zins-Floor ZZ 2
Interest Rate Supplement SIR 1(1)	Zins-Zusatz ZZ 1(1)
Interest Rate Swap SIR 2	Zinsswap ZZ 2
Interest Rate Swaption SIR 2	Zins-Swaption ZZ 2
J.	J.
Judgment of Insolvency GP 6(1)(a)(viii)	Insolvenzentscheidung AB 6(1)(a)(viii)
K.	K.
kind ("of the same kind") GP 3(2)(b)	Art („derselben Art“) AB 3(2)(b)
Knock-in Event SO 4(5)	Knock-in-Ereignis ZO 4(5)
Knock-out Event SO 4(5)	Knock-out-Ereignis ZO 4(5)
L.	L.
Latest Exercise Time SO 4(2)	Spätester Ausübungszeitpunkt ZO 4(2)
Lender SL 1(1)	Darlehensgeber WD 1(1)
Lending Fee SL 4	Darlehensgebühr WD 4
Liabilities MMA 1(3)	Verbindlichkeiten SI 1(3)
Loaned Securities SL 1(1)	Darlehenspapiere WD 1(1)
M.	M.
Margin MMA 1(3)	Sicherheiten SI 1(3)
Margin Claim GP 7(1)(a)	Sicherheitenansprüche AB 7(1)(a)
Margin Ratio MMA 1(3)	Deckungsquote SI 1(3)
Margin Provider MMA 1(1)	Sicherungsgeber SI 1(1)
Margin Recipient MMA 1(1)	Sicherungsnehmer SI 1(1)
Margin Securities MMA 1(1)	Wertpapiersicherheiten SI 1(1)
Market Disruption Convention D 4	Marktstörungsregelung D 4
Market Disruption Event D 4	Marktstörung D 4
Market Standard Documentation D 2	Marktstandarddokumentation D 2
Market Value GP 3(8); MMA 1(1)	Marktwert AB 3(8), SI 1(1)
Master Agreement SP 1; GP 1(1)	Rahmenvertrag BB1, AB 1(1)
Maximum Exercise Quantity SO 4(7)	Höchstausübungsbetrag ZO 4(7)

Minimum Exercise Quantity SO 4(6)	Mindestausübungsbetrag ZO 4(6)
Minimum Transfer Amount MMA 2(6)	Mindesttransferbetrag SI 2(6)
Modified, Modified Following GP 3(6)(c)	Modifiziert; Folgender Modifiziert AB 3(6)(c)
Multiple Exercise SO 4(7)	Mehrfachausübung ZO 4(7)
N.	N.
Net Exposure MMA 1(3)	Nettoausfallrisiko SI 1(3)
New Securities REPO 3(1)	Neue Wertpapiere REPO 3(1)
New Transaction REPO 6(2)(b)	Neues Geschäft REPO 6(2)(b)
No Adjustment SIR 4(11)	Keine Anpassung ZZ 4(11)
Non-Affected Party GP 6(2)(b)	Nicht betroffene Partei AB 6(2)(b)
Non-Defaulting Party GP 6(1)(b)	Vertragstreue Partei AB 6(1)(b)
Non-Deliverable Foreign Exchange Forward SFX 2	Non-Deliverable Forward ZFX 2
Non-Deliverable Foreign Exchange Option SFX 2	Non-Deliverable Option ZFX 2
Notional Amount SIR 2	Bezugsbetrag ZZ 2
O.	O.
Option SO 1(1)	Option ZO 1(1)
Option Transaction SO 1(1)	Optionsgeschäft ZO 1(1)
Options Supplement SO 1(1)	Options-Zusatz ZO 1(1)
Original Transactions REPO 6(2)	Ursprüngliche Geschäfte REPO 6(2)
P.	P.
Partial Exercise SO 4(6)	Teilausübung ZO 4(6)
Period End Date SIR 4(11)	Berechnungstichtag ZZ 4(11)
Physical Settlement SO 1(1)(a)(i); SO 1(1)(c)(i); SFX 2; SIR 2	Physische Lieferung ZO 1(1)(a)(i); ZO 1(1)(c)(i); ZFX 2; ZZ 2
Physically Settled Foreign Exchange Option SFX 2	Devisenoption mit Geschäftsabschluss ZFX 2
Physically Settled Interest Rate Swaption SIR 2	Zins-Swaption mit Geschäftsabschluss ZZ 2
Potential Final Settlement Amount MMA 1(3)	Potenzieller Abschlussbetrag SI 1(3)
Preceding GP 3(6)(a)	Vorangehender AB 3(6)(a)
Premium SO 1(1)	Prämie ZO 1(1)
Premium Payment Date SO 3	Fälligkeitstag für die Prämie ZO 3
Price Differential REPO 2(3)	Preisunterschied REPO 2(3)
Price Source SFX 3(5); SIR 4(5)	Preisquelle ZFX 3(5); ZZ 4(5)
Price Source Disruption Event SIR 4(9)	Preisquellenstörung ZZ 4(9)
Pricing Rate REPO 2(3)	Pensionsatz REPO 2(3)
Principal GP 10(10)(a)	Vertreter AB 10(10)(a)
Proceedings GP 11(2)	Verfahren AB 11(2)
Process Agent GP 11(3)	Zustellungsbevollmächtigter AB 11(3)
Product Annexes GP 1(2)	Produktanhänge AB 1(2)
Purchase Date REPO 2(1)	Kaufdatum REPO 2(1)
Purchase Price REPO 1(1)	Kaufpreis REPO 1(1)
Purchased Securities REPO 2(1)	Pensionspapiere REPO 2(1)
Put SO 2(2)	Verkaufsoption ZO 2(2)
Put Currency SFX 2	Verkaufswährung ZFX 2
Q.	Q.
Quotation Date GP 7(1)(a)	Preisfeststellungstag AB 7(1)
R.	R.
Reference Currency SFX 2	Referenzwährung ZFX 2
Repricing Date REPO 6(2)(a)	Preisanzpassungsdatum REPO 6(2)(a)
Repurchase Annex REPO 1(1)	Pensionsanhang REPO 1(1)
Repurchase Date REPO 2(2)	Rückkaufdatum REPO 2(2)
Repurchase Price REPO 2(3)	Rückkaufpreis REPO 2(3)

Repurchase Transactions REPO 1(1)	Pensionsgeschäfte REPO 1(1)
Reset Date SIR 4(5)	Zinsfeststellungstermin ZZ 4(5)
Return Date SL 2(2)	Rücklieferungsdatum WD 2(2)
S.	S.
Scheduled Exercise Day SO 2(1)	Vereinbarter Ausübungstag ZO 2(1)
Securities GP 3(2)(a)	Wertpapiere AB 3(2)(a)
Securities Lending Annex SL 1(1)	Wertpapierdarlehensanhang WD 1(1)
Securities Loans SL 1(1)	Wertpapierdarlehen WD 1(1)
Sell Back Price REPO 5(1)	Rückverkaufspreis REPO 5(1)
Seller REPO 1(1); SO 1(1); SFX 2; SIR 2	Verkäufer REPO 1(1), ZO 1(1), ZFX 2, ZZ 2
Seller's Office SO 4(1)	Geschäftsstelle des Verkäufers ZO 4(1)
Settlement Currency SFX 2	Erfüllungswährung ZFX 2
Settlement Currency Amount SFX 3(2)	Erfüllungswährungsbetrag ZFX 3(2)
Settlement Currency Rate SFX 3(5)	Referenzwährungskurs ZFX 3(5)
Settlement Date D 4; SIR 4(12)	Fälligkeitsstag D 4, ZZ 4(12)
Settlement Interest Rate SIR 4(5)	Referenzzinssatz ZZ 4(5)
Settlement Level SO 1(1)(b)	Referenzwert ZO 1(1)(b)
Settlement Price SO 1(1)(a)(ii)	Referenzpreis ZO 1(1)(a)(ii)
simultaneous REPO 2(3); D 4	gleichzeitig REPO 2(3), D 4
Special Provisions GP 1(2); SP 1	Besondere Bestimmungen AB 1(2), BB 1
Specified Jurisdiction GP 6(1)(a)(viii)	Relevanter Staat AB 6(1)(a)(viii)
Specified Transactions GP 6(1)(a)(v)	Relevante Geschäfte AB 6(1)(a)(v)
Strike Level SO 1(1)(b)	Basiswert ZO 1(1)(b)
Strike Price SO 1(1)(a); SFX 3(5)	Basispreis ZO 1(1)(a), ZFX 3(5)
Substitute Assets GP 3(2)(b)	Ersatzgegenstände AB 3(2)(b)
Successor Entity GP 6(1)(a)(vii)	Rechtsnachfolger AB 6(1)(a)(vii)
Successor Price Source SIR 4(9)	Nachfolgepreisquelle ZZ 4(9)
T.	T.
Termination Date D 4	Enddatum D 4
Trade Date D 4	Abschlussdatum D 4
Transaction GP 1(1)	Geschäft AB 1(1)
Transaction Value GP 7(1)(a)	Geschäftswert AB 7(1)(a)
U.	U.
Unexercised Quantity SO 4(4)	Nicht ausgeübter Betrag ZO 4(4)
Underlying Asset SO 1(1)(a)	Zugrunde liegender Vermögenswert ZO 1(1)(a)
Underlying Measurement SO 1(1)(b)	Zugrunde liegende Messgröße ZO 1(1)(b)
Underlying Transaction SO 1(1)(c); SIR 2	Grundgeschäft ZO 1(1)(c), ZZ 2
V.	V.
Valuation Agent MMA 1(2)	Bewertungsstelle SI 1(2)
Valuation Date MMA 1(3); D 4; SO 2(3)	Bewertungstag SI 1(3), D 4, ZO 2(3)
Valuation Percentage MMA 1(1)	Bewertungsquote SI 1(1)
Valuation Time D 4	Bewertungszeitpunkt D 4
W.	W.
Weighted Average SIR 4(5)	Gewichtetes Mittel ZZ 4(5)