



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

## CONVENTION-CADRE RELATIVE AUX OPERATIONS SUR INSTRUMENTS FINANCIERS

### INDEX DES DEFINITIONS

Edition janvier 2001

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,

GM signifie Annexe Relative à la Gestion des Marges pour les Opérations de Pension Livrée et les Opérations de Prêts de Titres.

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.**

Actifs de Substitution DG 3(2)(b)  
Agent de Calcul DG 7(1)(a) ; GM 1(2)  
Agent de Domiciliation DG 11(3)  
Annexe DP 1 ; DG 1(2)  
Annexe Pension Livrée PL 1(1)  
Annexe Prêt de Titres PT 1(1)  
Annexes Produit DG 1(2)  
Autorité Compétente DG 6(1)(a)(viii)(3)

**C.**

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  
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 de Cession PL 2(1)  
Date de Cotation DG 7(1)(a)  
Date de Livraison PT 2(1)  
Date de Modification du Prix PL 6(2)(a)  
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)  
De même nature DG 3(2)(b)  
Devise Contractuelle DG 3(1)  
Devise de Référence DG 7(1)(b)  
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)  
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)

**F.**

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

**G.**

Garant DG 5(2)  
Garantie DG 5(2)

**H.**

Haircut GM 1(3)

**I.**

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

**J.**

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)

**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)  
Montant Minimum de Transfert GM 2(6)  
Montants Dus DG 7(1)(a)

**N.**

Nouveaux Titres PL 3(1)  
Nouvelle Entité DG 6(1)(a)(vii)  
Nouvelle Opération PL 6(2)(b)

**O.**

Opération DG 1(1)  
Opération Initiale PL 6(2)  
Opération Sous Mandat DG 10(10)(a)  
Opérations d'Achat/Revente PL 5(1)  
Opérations Déterminées DG 6(1)(a)(v)

**P.**

Partie Affectée DG 6(2)(b)  
Partie Défaillante DG 6(1)(b)  
Partie Non Affectée DG 6(2)(b)  
Partie Non Défaillante DG 6(1)(b)  
Pays Désigné DG 6(1)(a)(viii)  
Pensions PL 1(1)  
Prêteur PT 1(1)  
Prêts de Titres PT 1(1)  
Prix à Terme PL 5(1)  
Prix de Cession PL 1(1)  
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)

**S.**

Seuil de Défaut DG 6(1)(a)(vi)  
Seuil de Risque GM 2(6)  
Simultané PL 2(3)  
Solde de Résiliation Final DG 7(1)(a)

**T.**

Taux de Change Applicable DG 7(1)(b)  
Taux de Défaut DG 3(5)  
Taux de la Pension PL 2(3)  
Taux Interbancaire DG 3(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)