

ČESKÁ BANKOVNÍ ASOCIACE

Na základě vzorové dokumentace publikované Evropskou bankovní federací

RÁMCOVÁ SMLOUVA O OBCHODOVÁNÍ NA FINANČNÍM TRHU

INDEX DEFINOVANÝCH TERMÍNŮ

Vydání 2009

Tento seznam obsahuje odkazy na dokumenty a oddíly, ve kterých jsou definovány níže uvedené termíny.

Zkratky použité v tomto seznamu znamenají:

ZVL znamená Zvláštní ustanovení,

OBEC znamená Obecná ustanovení,

REPO znamená Produktová příloha pro repo obchody,

CP znamená Produktová příloha pro půjčky cenných papírů,

D znamená Produktová příloha pro derivátové transakce,

ZAJ znamená Příloha o udržování finančního zajištění,

UROK znamená Doplněk k příloze o derivátech – Úrokové transakce,

DEVIZ znamená Doplněk k příloze o derivátech – Devizové transakce,

OP znamená Doplněk k příloze o derivátech – Opční transakce.

KOM znamená Doplněk k příloze o derivátech – Komoditní transakce.

Čísla bez závorek znamenají odkaz na oddíl příslušného dokumentu; čísla a písmena v závorkách znamenají odkaz na pododdíl a odstavce.

A.

Agent pro ocenění / Valuation Agent	ZAJ 1(2)	
Alternativní náklady na půjčku / Alternative Borrowing Cost		CP 2(5)(a)(i)
Alternativní pořizovací náklady / Alternative Purchase Cost		REPO 2(6)(b)(iii)
Americká opce / American Option	OP 2(1)	
Asijská opce / Asian Option	OP 2(1)	
Automatická realizace / Automatic Exercise	OP 4(4)	

B.

Bariéra / Barrier	OP 4(5)	
Bermudská opce / Bermuda Option	OP 2(1)	
Burza / Exchange	D 4	
Burzovní den / Exchange Business Day	D 4	

C.

Call / Call	OP 2(2)	
Celkový nominální objem / Total Notional Quantity		KOM3(4)
Cena vypořádání / Settlement Price	OP 1(1)(a)(ii)	
Cena zpětného prodeje / Sell Back Price		REPO 5(1)
Cenné papíry / Securities	OBEC 3(2)(a)	
Cenová sazba / Pricing Rate	REPO 2(3)	
Cenový rozdíl / Price Differential	REPO 2(3)	
Cenový zdroj / Price Source	DEVIZ 3(5); UROK 4(5); KOM 3(7)	
CZEONIA / CZEONIA	OBEC 3(5)	

Č.

Čas ocenění / Valuation Time	D 4	
Částečná realizace / Partial Exercise	OP 4(6)	
Částka měny / Currency Amount	UROK 2	
Částka měny vypořádání / Settlement Currency Amount		DEVIZ 3(2)
Částka období skládání / Compounding Period Amount		UROK 4(2)
Částka vypořádání v penězích / Cash Settlement Amount		OP 5(1); DEVIZ 3(4); KOM 4(4)
Částka závěrečného vyrovnání / Final Settlement Amount		OBEC 7(1)(a)
ČBA / CBA	OBEC 1(1)	
Čistá angažovanost / Net Exposure	ZAJ 1(3)	
Čistá cena / Clean Price	REPO 5(1)	

D.

Datum dodání / Delivery Date	CP 2(1)	
Datum expirace / Expiration Date	OP 2 (3); KOM 3(3)	
Datum kotace / Quotation Date	OBEC 7(1)(a)	
Datum koupě / Purchase Date	REPO 2(1)	
Datum obchodu / Trade Date	D 4	
Datum obnovení / Reset Date	UROK 4(5)	
Datum ocenění / Valuation Date	ZAJ 1(3); D 4; OP 5(2)	
Datum placení prémie / Premium Payment Date	OP 3	
Datum platby / Payment Date	KOM 3(3)	
Datum průměrování / Averaging Date	OP 2(3)	
Datum přecenění / Repricing Date	REPO 6(2)(a)	
Datum předčasného ukončení / Early Termination Date		OBEC 6(1)(b); OBEC 6(2)(b)
Datum skládání / Compounding Date	UROK 4(2)	
Datum stanovení ceny / Pricing Date	KOM 3(6)	
Datum účinnosti / Effective Date	D 4	
Datum ukončení / Termination Date	D 4	
Datum realizace / Exercise Date	OP 2(3)	
Datum vrácení / Return Date	CP 2(2)	
Datum vypořádání / Settlement Date	D 4; UROK 4(12); KOM 3(3)	
Datum zahájení / Commencement Date	OP 2(3)	
Datum zpětné koupě / Repurchase Date	REPO 2(2)	
Derivátové transakce / Derivative Transactions	D 1(1)	
Devizová opce / Foreign Exchange Option	DEVIZ 2	
Devizová opce bez dodání / Non-Deliverable Foreign Exchange Option		DEVIZ 2
Devizová opce vypořádaná v penězích / Cash Settled Foreign Exchange Option		DEVIZ 2
Devizové transakce / Foreign Exchange Transactions		DEVIZ 1(1)
Devizový spot / Foreign Exchange Spot	DEVIZ 2	
Distribuce / Distribution	REPO 2(7)(i); CP 2(6)(i)	
Dlužník / Borrower	CP 1(1)	

Doba kalkulace / Calculation Period	UROK 4(11); KOM 3(4)
Dodatečná částka období skládání / Additional Compounding Period Amount	UROK 4(2)
Dodatečný případ narušení trhu / Additional Market Disruption Event	KOM 5(1)
Dohoda o budoucí sazbě / Forward Rate Agreement (FRA)	UROK 2
Dohoda o narušení trhu / Market Disruption Convention	D 4
Doplňěk k Devizovým transakcím / Foreign Exchange Supplement	DEVIZ 1(1)
Doplňěk k Opčním transakcím / Options Supplement	OP 1(1)
Doplňěk k Úrokovým transakcím / Interest Rate Supplement	UROK 1(1)
Doplňěk pro Komoditní transakce / Commodity Supplement	KOM 1(1)
Dotčená strana / Affected Party	OBEC 6(2)(b)
E.	
Ekvivalent / Equivalent	REPO 2(3); CP 2(3)
EONIA / EONIA	OBEC 3(5)
Eurodolarová úmluva / Eurodollar Convention	UROK 4(11)
Evropská opce / European Option	OP 2(1)
F.	
Finanční kolaterál v penězích / Cash Margin	ZAJ 1(1)
Finanční kolaterál ve Finančních nástrojích / Margin Securities	ZAJ 1(1)
Finanční nástroje / Securities	OBEC 3(2)(a)
Finanční kolaterál / Margin	ZAJ 1(3)
Fyzické vypořádání / Physical Settlement	OP 1(1)(a)(i); OP 1(1)(c)(i); DEVIZ 2; UROK 2
Fyzicky vypořádaná devizová opce / Physically Settled Foreign Exchange Option	DEVIZ 2
H.	
Haircut / Haircut	ZAJ 1(1)
I.	
Integrovaný násobek / Integral Multiple	OP 4(6)
ISDA Komoditní definice / ISDA Commodity Definitions	KOM 3(1)
J.	
Jednotka / Unit	KOM 3(1)
K.	
Kalkulační agent / Calculation Agent	D 4
Kalkulační částka / Calculation Amount	UROK 4(3)
Konečné datum období / Period End Date	UROK 4(11)
Komodita / Commodity	KOM 3(1)
Komoditní cap / Commodity Cap	KOM 2
Komoditní collar / Commodity Collar	KOM 2
Komoditní floor / Commodity Floor	KOM 2
Komoditní forward / Commodity Forward	KOM 2
Komoditní obchodní den / Commodity Business Day	KOM 3(1)
Komoditní opce / Commodity Option	KOM 2
Komoditní swap / Commodity Swap	KOM 2
Komoditní transakce / Commodity Transactions	KOM 1(1) Konfirmace / Confirmation
Koupené finanční nástroje / Purchased Securities	REPO 2(1)
Kupní cena / Purchase Price	REPO 1(1)
Kupující / Buyer	REPO 1(1); OP 1(1); DEVIZ 2; UROK 2; KOM 2
Kurz měny vypořádání / Settlement Currency Rate	DEVIZ 3(5)
L.	
Likvidační hodnota / Default Value	OBEC 7(1)(a)
M.	
Maximální doba trvání narušení trhu / Maximum Days of Disruption	KOM 5(6)
Maximální uplatněné množství / Maximum Exercise Quantity	OP 4(7)
Měna call opce / Call Currency	DEVIZ 2
Měna put opce / Put Currency	DEVIZ 2
Měna vypořádání / Settlement Currency	DEVIZ 2
Měna vypořádání v penězích / Cash Settlement Currency	D 4
Měnový pár / Currency Pair	DEVIZ 3(5)
Měnový swap / Cross Currency Rate Swap	UROK 2
Metoda průměrování / Method of Averaging	KOM 3(6)
Metoda vypořádání v penězích / Cash Settlement Method	OP 5(1)

Mezibankovní úroková sazba / Interbank Rate OBEC 3(5)
 Minimální částka převodu / Minimum Transfer Amount ZAJ 2(6)
 Minimální realizované množství / Minimum Exercise Quantity OP 4(6)
 Modifikovaný, Modifikovaný následující / Modified, Modified Following OBEC 3(6)(c)

N.

Náhradní aktiva / Substitute Assets OBEC 3(2)(b)
 Náklady na půjčku / Borrowing Cost REPO 2(6)(a)(ii)
 Nápravný prostředek / Disruption Fallback KOM 5(5)
 Nárok na finanční kolaterál / Margin Claim OBEC 7(1)(a)
 Narostlý úrok / Accrued Interest REPO 5 (1)
 Následný cenový zdroj / Successor Price Source UROK 4(9)
 Následující / Following OBEC 3(6)(b)
 Nástupnická společnost / Successor Entity OBEC 6(1)(a)(vii)
 Nedotčená strana / Non-Affected Party OBEC 6(2)(b)
 Neporušující strana / Non-Defaulting Party OBEC 6(1)(b)
 Nerealizované množství / Unexercised Quantity OP 4(4)
 Nezávislá částka / Independent Amount ZAJ 1(1)
 Nominální částka / Notional Amount UROK 2
 Nominální objem / Notional Quantity KOM 3(4)
 Nominální objem za Dobu kalkulace / Notional Quantity per Calculation Period KOM3(4)
 Nová transakce / New Transaction REPO 6(2)(b)
 Nové finanční nástroje / New Securities REPO 3(1)

O.

Období skládání / Compounding Period UROK 4(2)
 Období realizace / Exercise Period OP 4(2)
 Obecná ustanovení / General Provisions ZVL 1; OBEC 1(1);
 Obchodní den / Business Day OBEC 3(7)
 Obchodní den realizace / Exercise Business Day OP 2(3)
 Opce / Option OP 1(1)
 Opce na měnový kurz / Currency Rate Option DEVIZ 3(5)
 Opce s pohyblivou sazbou / Floating Rate Option UROK 4(5)
 Opční transakce / Option Transactions OP 1(1), KOM 7
 Oznámení realizace / Exercise Notice OP 4(1)

P.

Paušální částka skládání / Flat Compounding Amount UROK 4(2)
 Paušální skládání / Flat Compounding UROK 4(2)
 Pevná cena / Fixed Price KOM3(5)
 Pevné částky / Fixed Amounts UROK 2; KOM 3(4)
 Pevná sazba / Fixed Rate UROK 4(4)
 Plánované datum realizace / Scheduled Exercise Date OP 2(1)
 Plátcé Pevné částky / Fixed Amount Payer UROK 3(1); KOM 3(2)
 Plátcé Pohyblivé částky / Floating Amount Payer UROK 3(1); KOM 3(2)
 Podkladová transakce / Underlying Transaction OP 1(1)(c); UROK 2
 Podkladové aktivum / Underlying Asset OP 1(1)(a)
 Podkladové měřítko / Underlying Measurement OP 1(1)(b)
 Pohyblivá cena / Floating Price KOM 3(6)
 Pohyblivé částky / Floating Amounts UROK 2; KOM 3(4)
 Pohyblivá sazba / Floating Rate UROK 4(5)
 Poměr finančního zajištění / Margin Ratio ZAJ 1(3)
 Poplatek za půjčení / Lending Fee CP 4
 Porušující strana / Defaulting Party OBEC 6(1)(b)
 Pořizovací náklady / Acquisition Cost CP 2(5)(b)(ii)
 Poskytovatel finančního kolaterálu / Margin Provider ZAJ 1(1)
 Poslední okamžik realizace / Latest Exercise Time OP 4(2)
 Potenciální částka závěrečného vyrovnání / Potential Final Settlement Amount ZAJ 1(3)
 Pozdní platba / Delayed Payment UROK 4(12)
 Práh angažovanosti / Exposure Threshold ZAJ 2(6)
 Prahová částka / Default Threshold OBEC 6(1)(a)(vi)
 Prémium / Premium OP 1(1)
 Procento ocenění / Valuation Percentage ZAJ 1(1)
 Procesní agent / Process Agent OBEC 11(3)
 Prodávající / Seller REPO 1(1); OP 1(1); DEVIZ 2; UROK 2; KOM 2
 Produktová příloha / Product Annexes OBEC 1(2)
 Protinároky / Counterclaims OBEC 7(4)

Provozovna / Booking Office	OBEC 9(3)
Provozovna Prodávajícího / Seller's Office	OP 4(1)
První okamžik realizace / Earliest Exercise Time	OP 4(2)
Předčasná platba / Early Payment	UROK 4(12)
Předcházející den / Preceding day	OBEC 3(6)(a)
Přeměna společnosti / Corporate Restructuring	OBEC 6(1)(a)(vii)
Příjemce finančního kolaterálu / Margin Recipient	ZAJ 1(1)
Příloha / Annex	ZVL1; OBEC1(2)
Příloha pro derivátové transakce / Derivatives Annex	D 1(1)
Příloha pro půjčky cenných papírů / Securities Lending Annex	CP 1(1)
Příloha pro repo obchody / Repurchase Annex	REPO 1(1)
Případ absence / Knock-out Event	OP 4(5)
Případ narušení cenového zdroje / Price Source Disruption Event	UROK 4(9)
Případ narušení trhu / Market Disruption Event	D 4; KOM 5(1)
Případ nemožnosti plnění / Impossibility Event	OBEC 6(2)(a)(ii)
Případ porušení / Event of Default	OBEC 6(1)(a)
Případ výskytu / Knock-in Event	OP 4(5)
Příslušná jurisdikce / Specified Jurisdiction	OBEC 6(1)(a)(viii)
Příslušný orgán / Competent Authority	OBEC 6(1)(a)(viii)(3)
Příslušný směnný kurz / Applicable Exchange Rate	OBEC 7(1)(b)
Půjčené cenné papíry / Loaned Securities	CP 1(1)
Půjčky cenných papírů / Securities Loans	CP 1(1)
Put / Put	OP 2(2)
Původní transakce / Original Transactions	REPO 6(2)

R.

Rámcová smlouva / Master Agreement	ZVL 1; OBEC 1(1)
Realizační cena / Strike Price	OP 1(1)(a); DEVIZ 3(5)
Realizační úroveň / Strike Level	OP 1(1)(b)
Realizované množství / Exercise Quantity	OP 4(6)
Referenční cena Komodity / Commodity Reference Price	KOM 3(7)
Referenční měna / Reference Currency	DEVIZ 2
Relevantní cena / Relevant Price	KOM 3(6)
Repo obchody / Repurchase Transactions	REPO 1(1)
Rovnocenné / Kind ("of the same kind")	OBEC 3(2)(b)
Rozdíl realizační ceny / Strike Price Differential	KOM 4(5)
Rozhodnutí o úpadku / Judgment of Insolvency	OBEC 6(1)(a)(viii)
Ručitel / Guarantor	OBEC 5(2)

Ř.

Řízení / Proceedings	OBEC 11(2)
----------------------	------------

S.

Sazba úroku z prodlení / Default Rate	OBEC 3(5)
Skládání / Compounding	UROK 4(2)
Smlouva / Agreement	OBEC 1(2)
Smluvní měna / Contractual Currency	OBEC 3(1)
Souběžná / Simultaneous	REPO 2(3); D 4
Splatné částky / Amounts Due	OBEC 7(1)(a)
Správní poplatky / Documentary Tax	OBEC 4(2)
Standardní tržní dokumentace / Market Standard Documentation	D 2
Stanovená cena / Specified Price	KOM 3(7)
Strana provádějící kalkulaci / Calculation Party	OBEC 7(1)(a)

T.

Termínová cena / Forward Price	REPO 5(1)
Termínový devizový obchod bez dodání / Non-Deliverable Foreign Exchange Forward	DEVIZ 2
Termínový devizový obchod / Foreign Exchange Forward	DEVIZ 2
Termínový kurz / Forward Rate	DEVIZ 3(5)
Transakce / Transaction	OBEC 1(1)
Transakce jménem jiné osoby / Agency Transaction	OBEC 10(10)(a)
Transakce koupě a zpětného prodeje / Buy/Sell Back Transactions	REPO 5(1)
Transakční hodnota / Transaction Value	OBEC 7(1)(a)
Tržní hodnota / Market Value	OBEC 3(8); ZAJ 1(1)

U.

Úpadkové řízení / Insolvency Proceeding	OBEC 6(1)(a)(viii)
---	--------------------

Upravená čistá angažovanost / Adjusted Net Exposure ZAJ 1(1)
 Upravená kalkulační částka / Adjusted Calculation Amount UROK 4(2)
 Úroková báze / Day Count Fraction (1/1; Actual/360; 30E/360; 30/360; 360/360 (německý standard); Actual/365; Actual/Fixed 365; 365/365 (německý standard); Actual/Actual (standard AFB/BBF) UROK 4(7)
 Úroková sazba vypořádání / Settlement Interest Rate UROK 4(5)
 Úroková swapce / Interest Rate Swaption UROK 2
 Úroková swapce vypořádaná fyzicky / Physically Settled Interest Rate Swaption UROK 2
 Úroková swapce vypořádaná v penězích / Cash Settled Interest Rate Swaption UROK 2
 Úrokové transakce / Interest Rate Transactions UROK 1(1)
 Úrokový cap / Interest Rate Cap UROK 2
 Úrokový floor / Interest Rate Floor UROK 2
 Úrokový swap / Interest Rate Swap UROK 2
 Úroveň vypořádání / Settlement Level OP 1(1)(b)

V.

Vážený průměr / Weighted Average UROK 4(5)
 Věřitel / Lender CP 1(1)
 Vícenásobná realizace / Multiple Exercise OP 4(7)
 Vybrané transakce / Specified Transactions OBEC 6(1)(a)(v)
 Vyloučení úprav / No Adjustment UROK 4(11)
 Vypořádání v penězích / Cash Settlement OP 1(1)(a)(ii); OP 1(1)(c)(ii); DEVIZ 2; UROK 2

Z.

Zahájení / Commence OBEC 6(1)(a)(viii)
 Základní částka období skládání / Basic Compounding Period Amount UROK 4(2)
 Základní měna / Base Currency OBEC 7(1)(b)
 Záruka / Guarantee OBEC 5(2)
 Zastoupený / Principal OBEC 10(10)(a)
 Zástupce / Agent OBEC 10(10)(a)
 Závazky / Liabilities ZAJ 1(3)
 Změna okolností / Change of Circumstances OBEC 6(2)(a)
 Zpětná kupní cena / Repurchase Price REPO 2(3)
 Zvláštní ustanovení / Special Provisions OBEC 1(2); ZVL 1