

ČESKÁ BANKOVNÍ ASOCIACE

Na základě vzorové dokumentace publikované Evropskou bankovní federací

RÁMCOVÁ SMLOUVA O OBCHODOVÁNÍ NA FINANČNÍM TRHU

INDEX DEFINOVANÝCH TERMÍNŮ

Vydání 2006

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.

Číslo bez závorek znamená 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)	
Cena vypořádání / Settlement Price	OP 1(1)(a)(ii)	
Cena zpětného prodeje / Sell Back Price	REPO 5(1)	

Cenová sazba / Pricing Rate	REPO 2(3)	
Cenový rozdíl / Price Differential	REPO 2(3)	
Cenový zdroj / Price Source	DEVIZ 3(5); UROK 4(5)	
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)	
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)	
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 prémia / Premium Payment Date	OP 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 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)	
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)	
Dodatečná částka období skládání / Additional Compounding Period Amount	UROK 4(2)	
Dohoda o budoucí sazbě / Forward Rate Agreement (FRA)	UROK 2	

Dohoda o narušení trhu / Market Disruption Convention D 4
 Doplněk k Devizovým transakcím / Foreign Exchange Supplement DEVIZ 1(1)
 Doplněk k Opčním transakcím / Options Supplement OP 1(1)
 Doplněk k Úrokovým transakcím / Interest Rate Supplement UROK 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.

Integrální násobek / Integral Multiple OP 4(6)

K.

Kalkulační agent / Calculation Agent D 4
 Kalkulační částka / Calculation Amount UROK 4(3)
 Konečné datum období / Period End Date UROK 4(11)
 Konfirmace / Confirmation OBEC 2(2)
 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
 Kurz Měny vypořádání / Settlement Currency Rate DEVIZ 3(5)

L.

Likvidační hodnota / Default Value OBEC 7(1)(a)

M.

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 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)
 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
 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)
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 částka / Fixed Amounts UROK 2
Pevná sazba / Fixed Rate UROK 4(4)
Plánované datum realizace / Scheduled Exercise Date OP 2(1)
Plátce pevné částky / Fixed Amount Payer UROK 3(1)
Plátce pohyblivé částky / Floating Amount Payer UROK 3(1)
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 částka / Floating Amounts UROK 2
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
Produktová příloha / Product Annexes OBEC 1(2)
Protinároky / Counterclaims OBEC 7(4)
Provozovna / Booking Office OBEC 9(3)
Provozovna Proávajícího / Seller's Office OP 4(1)
První okamžik realizace / Earliest Exercise Time OP 4(2)
Předčasná platba / Early Payment UROK 4(12)
Předcházející / Preceding 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
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 měna / Reference Currency	DEVIZ 2
Repo obchody / Repurchase Transactions	REPO 1(1)
Rovnocenné / Kind ("of the same kind")	OBEC 3(2)(b)
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
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 kurs / 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))
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