



Finansēšana pret ieguldījumu portfeļa ķīlu

Pakalpojumu cenrādis

Vispārējie noteikumi

1. Pirmās divās finansēšanas dienās piemēro minimālo kapitāla lietošanas procentu likmi (gadā), kuru aprēķina pēc šādas formulas:

$$\text{Minimālā kapitāla lietošanas procentu likme (gadā)} = \text{mainīgā procentu likme}^1 + 2,25\%$$

Minimālo kapitāla lietošanas procentu likmi nepiemēro, ja vienas dienas laikā notiek iepriekšējās finansēšanas dzēšana un jaunās finansēšanas piešķiršana.

2. Sākot ar finansēšanas trešo dienu, piemēro kapitāla lietošanas procentu likmi (gadā), kuru aprēķina pēc šādas formulas:

$$\text{Kapitāla lietošanas procentu likme (gadā)}^2 = \text{mainīgā procentu likme}^1 + \text{bruto marža}$$

3. Finansēšanas atļautās valūtas: USD, EUR, RUB.

Finansēšanas nosacījumi³

| Ieguldījumu aktīvu kategorija | Valūta | Pieejamais kredīta limits ⁴ | Nodrošinājuma nosacījumi ⁴ | | | Bruto marža |
|--|--|--|---------------------------------------|--------------------|-----------------|-------------|
| | | | INITL ⁵ | MAINT ⁶ | SL ⁷ | |
| Valdības obligācijas ⁸ | | | | | | |
| ASV valdības obligācijas ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot) | USD | 96% | 4% | 3% | 2% | 2,75% |
| ASV valdības obligācijas ar dzēšanas termiņu virs 5 gadiem | USD | 94% | 6% | 4% | 2% | 3,00% |
| Citu valstu valdības obligācijas ar kredītreitingu: | | | | | | |
| AA- un augstāku, ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot) | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 95% | 5% | 4% | 2% | 3,00% |
| AA- un augstāku, ar dzēšanas termiņu virs 5 gadiem | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 94% | 6% | 4% | 2% | 3,00% |
| BBB – un augstāku, ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot) | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 90% | 10% | 8% | 6% | 4,00% |
| BBB – un augstāku, ar dzēšanas termiņu virs 5 gadiem | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 85% | 15% | 10% | 8% | 4,00% |
| BB+, BB un BB- , ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot) | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 80% | 20% | 15% | 10% | 4,50% |
| BB+, BB un BB- (neutral outlook), ar dzēšanas termiņu virs 5 gadiem | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 75% | 25% | 20% | 15% | 4,50% |
| B+, B un B- (neutral outlook) | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 65% | 35% | 30% | 25% | 4,75% |

¹ Attiecīgā procentu likme: USD – Federal Funds likme, EUR – ECB refinansēšanas likme, RUB – CBR bāzes likme (key rate).

² Kapitāla lietošanas procentu likme tiek aprēķināta saskaņā ar „ABLV Bank, AS, vispārējo darījumu noteikumu” (NOT.001) B14. sadaļas nosacījumiem.

³ Banka ir tiesīga vienpusēji grozīt finansēšanas nosacījumus kādam noteiktā ieguldījumu aktīvu kategorijā ietilpstošam finanšu instrumentam, norādot to atsevišķā paziņojumā klientam. Šādi grozījumi ir attiecināmi tajā skaitā uz finansēšanas pret ieguldījumu portfeļa ķīlu darījumiem, kuri ir noslēgti grozījumu spēkā stāšanās brīdī. Ja šādu grozījumu rezultātā klientam iestājas nepietiekama nodrošinājuma situācija, turpmākajā finansēšanas pret ieguldījumu portfeļa ķīlu darījumu izpildē ir ievērojama „ABLV Bank, AS, vispārējo darījumu noteikumu” (NOT.001) B14. sadaļā paredzētā kārtība.

⁴ Uzrādīts procentuālais apmērs no ieguldījumu aktīvu tirgus vērtības.

⁵ Initial Margin – sākotnējās maržinālās prasības, kas nosaka pieļaujamo kredīta limitu.

⁶ Maintenance Margin – maržinālo prasību līmenis, kuru sasniegšana Banka ir tiesīga pieprasīt nodrošinājuma palielināšanu vai kredīta apmēra samazināšanu.

⁷ Stop Loss – maržinālo prasību līmenis, kuru sasniegšana klientu pozīciju aizvēršana bezakcepta kārtībā, lai samazinātu kredīta apmēru.

⁸ Saskaņā ar Standard & Poor's reitingiem vai citu kredītreitingu aģentūru atbilstošo reitingu. Pamatojoties uz atsevišķu klienta pieteikumu, Banka var noslēgt ar klientu finansēšanas pret ieguldījumu portfeļa ķīlu darījumu, kura saistību izpildi nodrošina obligācijas, kurām to sākotnējās izvietošanas ietvaros vēl nav piešķirts kredītreitings, Bankai iekļaujot šādas obligācijas kādā no cenrādī norādītajām ieguldījumu aktīvu kategorijām un par to paziņojot klientam.

| Ieguldījumu aktīvu kategorija | Valūta | Pieejamais kredīta limits | Nodrošinājuma nosacījumi | | | Bruto marža |
|--|--|---------------------------|--------------------------|-------|-----|-------------|
| | | | INITL | MAINT | SL | |
| Korporatīvās obligācijas¹ (izņemot ABLV Bank, AS, emitētās obligācijas) | | | | | | |
| Korporatīvās obligācijas ar kredītreitingu: | | | | | | |
| BBB – un augstāku | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 75% | 25% | 20% | 15% | 4,40% |
| BB+, BB un BB- | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 60% | 40% | 35% | 30% | 5,25% |
| B+, B un B- | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 50% | 50% | 45% | 40% | 6,00% |
| ABLV Bank, AS, emitētās obligācijas | | | | | | |
| ABLV Bank, AS, emitētās obligācijas (izņemot subordinētās ² obligācijas) | USD, EUR | 90% | 10% | 7% | 4% | 3,00% |
| Akcijas | | | | | | |
| Biržā tirgojamās akcijas un biržā tirgotie indeksu fondi (ETF) ar kapitalizāciju: | | | | | | |
| virs 1 miljarda USD (ieskaitot) | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB | 70% | 30% | 25% | 20% | 9,75% |
| virs 300 miljoniem USD (ieskaitot), bet ne vairāk kā 1 miljards USD | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB | 60% | 40% | 35% | 30% | 10,25% |
| virs 100 miljoniem USD (ieskaitot), bet ne vairāk kā 300 miljoni USD | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB | 50% | 50% | 45% | 40% | 10,75% |
| Valdības un korporatīvās obligācijas, akcijas, kas neietilpst nevienā no iepriekš minētajām apakšgrupām attiecīgā ieguldījumu aktīvu kategorijā | | | | | | |
| Valdības un korporatīvās obligācijas, akcijas un indeksu fondi (ETF), kas atzīti par finansējamiem (izņemot defolētējušos emitentus) ³ | USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB, LTL | 10% | 90% | 85% | 80% | 15,00% |
| ABLV Asset Management, IPAS, pārvaldāmo fondu ieguldījumu apliecības | | | | | | |
| ABLV Emerging Markets Bond Fund | USD, EUR | 80% | 20% | 15% | 10% | 4,25% |
| ABLV Global Corporate USD Bond Fund | USD | | | | | |
| ABLV European Corporate EUR Bond Fund | EUR | 75% | 25% | 20% | 15% | 5,25% |
| ABLV High Yield CIS Bond Fund | USD, RUB | | | | | |
| ABLV Global Stock Index Fund | USD, EUR | | | | | |
| ABLV US Industry USD Equity Fund | USD | 70% | 30% | 20% | 15% | 9,75% |
| ABLV European Industry EUR Equity Fund | EUR | | | | | |
| Atlikumi dārgmetālu kontos | XAU, XPT, XPD, XAG | 70% | 30% | 25% | 20% | 5,00% |
| Atlikumi naudas kontos | | 90% | 10% | 0% | 0% | 5,00% |

Fiksētā nokavējuma procentu likme⁴, ko piemēro:

| | |
|--|----------|
| kredīta limita ⁵ pārsniegšanas gadījumā | 24% gadā |
| izmantojot finansēšanu neatļautās valūtās | 36% gadā |

¹ Saskaņā ar Standard & Poor's reitingiem vai citu kredītreitingu aģentūru atbilstošu reitingu. Pamatojoties uz atsevišķu klienta pieteikumu, Banka var noslēgt ar klientu finansēšanas pret ieguldījumu portfeļa ķīlu darījumu, kura saistību izpildi nodrošina obligācijas, kurām to sākotnējās izvietojuma ietvaros vēl nav piešķirts kredītreitings, Bankai iekļaujot šādas obligācijas kādā no cenrādī norādītajām ieguldījumu aktīvu kategorijām un par to paziņojot klientam.

² Obligācijas, kas emitētas ar mērķi piesaistīt līdzekļus subordinētā kapitāla palielināšanai.

³ Papildu informācija par šiem instrumentiem ir pieejama pēc pieprasījuma.

⁴ „ABL V Bank, AS, vispārējo darījumu noteikumu” (NOT.001) B14. sadaļas izpratnē, kopējās procentu likmes sastāvdaļa.

⁵ Kredīta limits „ABL V Bank, AS, vispārējo darījumu noteikumu” (NOT.001) B14. sadaļas izpratnē.