



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 obligācijas⁸						
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%
Baltkrievijas un Ukrainas valdības obligācijas		Netiek finansētas				
Citu valstu valdības obligācijas ar kredītreitingu:						
AA- un augstāku, ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot)	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	95%	5%	4%	2%	3,00%
AA- un augstāku, ar dzēšanas termiņu virs 5 gadiem	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	94%	6%	4%	2%	3,00%
BBB – un augstāku, ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot)	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	90%	10%	8%	6%	4,00%
BBB – un augstāku, ar dzēšanas termiņu virs 5 gadiem	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	85%	15%	10%	8%	4,00%
BB+, BB un BB-, ar dzēšanas termiņu līdz 5 gadiem (ieskaitot)	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	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	75%	25%	20%	15%	4,50%
B+, B un B- (neutral outlook)	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	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 ⁴	Nodrošinājuma nosacījumi ⁴			Bruto marža
			INITL ⁵	MAINT ⁶	SL ⁷	
Korporatīvās obligācijas¹						
(izņemot ABLV Bank, AS, emitētās obligācijas) ar emisijas apjomu 100 miljonu USD un vairāk						
Baltkrievijas un Ukrainas emitentu korporatīvās parastās un subordinētās obligācijas		Netiek finansētas				
Citu emitentu korporatīvās parastās un subordinētās obligācijas ar kredītreitingu:						
BBB – un augstāku	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	75%	25%	20%	15%	4,40%
	RUB	65%	35%	30%	25%	4,40%
BB+, BB un BB-	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	60%	40%	35%	30%	5,25%
	RUB	50%	50%	45%	40%	5,25%
Citu emitentu korporatīvās parastās obligācijas ar kredītreitingu:						
B+ un B	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	50%	50%	45%	40%	6,00%
	RUB	40%	60%	55%	50%	6,00%
B-	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	40%	60%	55%	50%	6,25%
	RUB	30%	70%	65%	60%	6,25%
Citu emitentu korporatīvās subordinētās obligācijas ar kredītreitingu:						
B+ un B	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	40%	60%	55%	50%	6,50%
	RUB	30%	70%	65%	60%	6,50%
B-	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	30%	70%	65%	60%	7,00%
	RUB	20%	80%	75%	70%	7,00%
ABL V Bank, AS, emitētās obligācijas						
ABL V Bank, AS, emitētās obligācijas (izņemot subordinētās ² obligācijas)	USD, EUR	90%	10%	7%	4%	3,00%
Akcijas						
Baltkrievijas un Ukrainas emitentu biržā tirgojamās akcijas		Netiek finansētas				
Citu emitentu biržā tirgojamās akcijas un biržā tirgotie indeksu fondi (ETF) ar kapitalizāciju:						
virs 1 miljarda USD (ieskaitot)	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	70%	30%	25%	20%	9,75%
	RUB	60%	40%	35%	30%	9,75%
virs 300 miljoniem USD (ieskaitot), bet ne vairāk kā 1 miljards USD	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	60%	40%	35%	30%	10,25%
	RUB	50%	50%	45%	40%	10,25%
virs 100 miljoniem USD (ieskaitot), bet ne vairāk kā 300 miljoni USD	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF	50%	50%	45%	40%	10,75%
	RUB	40%	60%	55%	50%	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 defoltējušos emitentus) ³	USD, EUR, GBP, CAD, SEK, CHF, RUB	10%	90%	85%	80%	15,00%
ABL V Asset Management, IPAS, pārvaldāmo fondu ieguldījumu apliecības						
ABL V Emerging Markets Bond Fund	USD, EUR	80%	20%	15%	10%	4,25%
ABL V Global Corporate USD Bond Fund	USD					
ABL V European Corporate EUR Bond Fund	EUR	75%	25%	20%	15%	5,25%
ABL V High Yield CIS Bond Fund	USD, RUB					
ABL V Global Stock Index Fund	USD, EUR					
ABL V US Industry USD Equity Fund	USD	70%	30%	20%	15%	9,75%
ABL V European Industry EUR Equity Fund	EUR					

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 cenrādi 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.

Ieguldījumu aktīvu kategorija	Valūta	Pieejamais kredīta limits ⁴	Nodrošinājuma nosacījumi ⁴			Bruto marža
			INITL ⁵	MAINT ⁶	SL ⁷	
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 likme¹, ko piemēro:

kredīta limita ² pārsniegšanas gadījumā	24% gadā
izmantojot finansēšanu neatļautās valūtās	36% gadā

¹ „ABL V Bank, AS, vispārējo darījumu noteikumu” (NOT.001) B14. sadaļas izpratnē, kopējās procentu likmes sastāvdaļa.

² Kredīta limits „ABL V Bank, AS, vispārējo darījumu noteikumu” (NOT.001) B14. sadaļas izpratnē.