

SPĒKĀ
no 2020.gada 9.oktobra

APSTIPRINĀTS
Nasdaq Riga, AS
valdes sēdē
2020.gada 8.oktobrī

Nasdaq Riga noteikumi

“PAR LATVIJAS REPUBLIKAS VĒRTSPAPĪRU, KAS EMITĒTI GMTN PROGRAMMAS IETVAROS, PIEDĀVĀJUMU UN PĀRDOŠANU SĀKOTNĒJĀ IZVIETOŠANĀ NASDAQ RIGA TIRDZNICĪBAS SISTĒMĀ”

Nasdaq Riga noteikumi “Par Latvijas Republikas vērtspapīru, kas sākotnēji emitēti GMTN programmas ietvaros, piedāvājumu un pārdošanu sākotnējā izvietojumā Nasdaq Riga tirdzniecības sistēmā” (turpmāk - **Noteikumi**) nosaka kārtību, kādā tiek veikta Latvijas Republikas vērtspapīru sērijas, kas sākotnēji emitēti GMTN programmas ietvaros (turpmāk – **GMTN vērtspapīri**), sākotnējā izvietojumā Latvijas Republikā konkurējošās daudzscenu izsolēs (turpmāk – konkurējošās izsoles), fiksētas likmes apjoma izsolēs (turpmāk – nekonkurējošās izsolēs) un valsts vērtspapīru tiešajā pārdošanā Nasdaq Riga (turpmāk – Birža) tirdzniecības sistēmā (turpmāk – **GMTN vērtspapīri iekšējā tirgū**). Uz GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējo izvietojumu attiecas šie noteikumi, kā arī citi Latvijas Republikā spēkā esošie normatīvie akti, tai skaitā Latvijas Republikas GMTN programmas saistošā vērtspapīru dokumentācija (turpmāk – **GMTN dokumentācija**).

1.LIETOTIE TERMINI

- 1.1. Noteikumos lietotie termini un jēdzieni, kas nav skaidroti šajos noteikumos, atbilst Luksemburgas Biržas un Valsts kases mājas lapā publicētai Latvijas GMTN dokumentācijai, piem., emisijas prospektā (angl. *Offering Circular*) un attiecīgās GMTN vērtspapīru sērijas sākotnējās izvietojuma raksturlielumos (angl. *Pricing Supplement*) lietotajiem terminiem un jēdzieniem.
- 1.2. Biržas biedrs – Latvijas Republikā reģistrēta vai ārvalstu juridiska persona, kura Biržas noteikumos noteiktajā kārtībā ir ieguvusi Biržas biedra statusu.
- 1.3. Maksimāli pieļaujamā peļņas likme – tāda Valsts kases noteikta GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū peļņas likme, par kuru augstāk uzdevumi konkurējošā izsolē sākotnējā izvietojumā netiek apmierināti.
- 1.5. Nominālvērtību apjoms – GMTN vērtspapīru nominālvērtību kopsумma, kas bez atlikuma dalās ar attiecīgās GMTN vērtspapīru sērijas viena vērtspapīra aprēķina vērtību (angl. *calculation amount*).

- 1.6. Minimālais iegādes apjoms – atbilstoši GMTN dokumentācijā un attiecīgajā GMTN vērtspapīru sērijas sākotnējās izvietošanas raksturlielumos norādītajam.
- 1.7. Darījums – darījums, kas tiek veikts ar GMTN vērtspapīriem iekšējā tirgū konkurējošā daudz cenu izsolē, fiksētas likmes apjoma (nekonkurējošā) izsolē un vērtspapīru tiešajā pārdošanā, kas atbilstoši Biržas noteiktajai kārtībai ir noslēgts vai reģistrēts Biržas tirdzniecības sistēmā.
- 1.8. ISIN kods – starptautiski atzīts finanšu instrumentu identifikācijas numurs (angl. – *International Securities Identification Number*), kuru piešķir katram atvietojamam finanšu instrumentu kopumam - viena un tā paša emitenta izlaistiem finanšu instrumentiem ar vienādiem raksturlielumiem.
- 1.9. Primārais dīleris – Biržas biedrs, kas par dalību valsts iekšējā aizņēmuma vērtspapīru un GMTN programmas ietvaros emitēto vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējā un otrreizējā tirgus organizēšanā ir noslēdzis ar Valsts kasi līgumu, kurā ir atrunāti GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū norēķinu jautājumi un noteikta atbildība par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū norēķinu saistību neizpildi (turpmāk – Primārā dīlera līgums).

2. VISPĀRĪGIE NOTEIKUMI

- 2.1. GMTN vērtspapīrus iekšējā tirgū emitē Latvijas Republika, kuras vārdā darbojas Valsts kase. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējā izvietošana ar Biržas starpniecību tiek veikta, izmantojot Biržas tirdzniecības sistēmu, saskaņā ar starp Valsts kasi un Biržu noslēgto līgumu un šiem noteikumiem. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējās izvietošanas un norēķinu datumus, kā arī piedāvātā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū laidiena raksturlielumus nosaka atsevišķi Valsts kases rīkojumā.
- 2.2. Vērtspapīru sākotnējā izvietošanā ir tiesības piedalīties Primārajiem dīleriem saskaņā ar noslēgto līgumu ar Valsts kasi, ja vien Valsts kases rīkojumā par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējo izvietošanu nav noteikts, ka tiesības piedalīties ir visiem Biržas biedriem.
- 2.3. Valsts kase ne vēlāk kā 4 (četras) darba dienas pirms sākotnējās izvietošanas informē Biržu, ja sākotnējā izvietošanā būs tiesības piedalīties visiem Biržas biedriem. Gadījumos, kad ārkārtas apstākļu dēļ Valsts kase nevar ievērot iepriekš noteikto informācijas iesniegšanas termiņu, Valsts kase šo informāciju sniedz ne vēlāk kā līdz plkst. 10.00 iepriekšējā darba dienā pirms sākotnējās izvietošanas.
- 2.4. Birža GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējās izvietošanas ietvaros veic šādas funkcijas:
 - 2.4.1. nodrošina nepieciešamās informācijas tehnoloģijas GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējās izvietošanas procesa norisei;
 - 2.4.2. elektroniskā formā nodrošina Biržas biedriem un Valsts kasei informāciju par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējās izvietošanas rezultātiem un nodrošina informācijas pieejamību Biržas mājas lapā, iekļaujot publiskās komunikācijas saistību atrunu attiecībā uz GMTN vērtspapīriem (turpmāk tekstā – saistību atruna);

- 2.4.3. nodrošina darījumu informāciju iepriekš saskaņotā formātā Valsts kasei un katram Biržas biedram, kurš piedalījies sākotnējā izvietojumā, un kas nepieciešama, lai veiktu tālākos norēķinu procesa soļos;
 - 2.4.4. veic citas funkcijas, kuras paredz starp Valsts kasi un Biržu noslēgtie līgumi par sadarbību vērtspapīru sākotnējā izvietojumā un atpirkšanā;
 - 2.4.5. nodrošina, ka Biržas biedram Tirdzniecības sistēmā ir pieejama informācija par attiecīgajā izsolē veiktajiem darījumiem, izņemot informāciju par darījumā iesaistītajām pusēm. Biržas biedrs Tirdzniecības sistēmā var identificēt paša noslēgtos darījumus;
 - 2.4.6. nodrošina, ka Biržas mājas lapā ir publicēts primāro dīleru saraksts.
- 2.5. Valsts kase apstiprina (telefoniski vai e-pastā) GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējās izvietojuma rezultātus, izskata pretenzijas un citus gadījumus, kā arī pieņem citus lēmumus vērtspapīru sākotnējās izvietojuma gaitā.
 - 2.6. Norēķini par darījumiem ar GMTN vērtspapīriem iekšējā tirgū sākotnējās izvietojuma ietvaros tiek veikti saskaņā ar starp Valsts kasi un Primāro dīleri noslēgto līgumu, kā arī ievērojot GMTN dokumentācijā noteikto.
 - 2.7. Biržas biedri reizi mēnesī par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū iegādāšanos sākotnējā izvietojumā maksā Biržai komisijas maksu saskaņā ar Biržas noteiktajiem tarifiem. Biržas biedram rēķins ir jāapmaksā Biržas noteiktajā termiņā, kas norādīts Biržas izrakstītajā rēķinā.

3. VĒRTSPAPĪRU SĀKOTNĒJĀ IZVIETOŠANA KONKURĒJOŠĀ IZSOLĒ

- 3.1. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū izvietojuma konkurējošā izsolē tiek veikta saskaņā ar Valsts kases rīkojumu par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisiju (turpmāk – Valsts kases rīkojums). Vienā dienā var notikt viena vai vairākas konkurējošās izsoles. Konkurējošās izsoles ir slēgtas, ja vien Valsts kases rīkojumā nav norādīts citādi.
- 3.2. Valsts kase pirms katras konkurējošās izsoles elektroniski nosūta Biržai Valsts kases rīkojumu par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisiju, kurā norāda informāciju par izsolāmo GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū raksturlielumiem, kā arī papildus norāda katras konkurējošās izsoles datumu, sākuma laiku un laiku, līdz kuram tiek pieņemti pieteikumi, ja nepieciešams, norādot arī citu papildus informāciju. Valsts kase šajā punktā minēto informāciju nosūta Biržai ne vēlāk kā 4 (četras) darba dienas vai gadījumos, kad ārkārtas apstākļu dēļ Valsts kase nevar ievērot iepriekš noteikto informācijas iesniegšanas termiņu, ne vēlāk kā līdz plkst. 10.00 iepriekšējā darba dienā pirms katras konkurējošās izsoles. Vienlaicīgi Valsts kase nodrošina norādītās informācijas pieejamību Valsts kases mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.
- 3.3. Birža pēc šo noteikumu 3.2.punktā minētā Valsts kases rīkojuma saņemšanas nekavējoties minēto informāciju elektroniskā formā nosūta Biržas biedriem un nodrošina informācijas pieejamību Biržas mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.
- 3.4. Konkurējošā izsole notiek, ja uz to pieteicies vismaz viens Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties izsolē.

- 3.5. Lai piedalītos konkurējošā izsolē, Biržas biedram, kuram ir tiesības piedalīties izsolē, konkurējošās izsoles dienā līdz Valsts kases noteiktajam laikam jāiesniedz Biržas tirdzniecības sistēmā vismaz viens uzdevums. Visi konkurējošai izsolei iesniegtie uzdevumi līdz Valsts kases noteiktajam pieteikumu iesniegšanas laikam var tikt atsaukti vai grozīti.
- 3.6. Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties konkurējošā izsolē, izsolē piedalās ar vienu vai vairākiem uzdevumiem, norādot katrā uzdevumā iegādājamo vērtspapīru nominālvērtību apjomu, ņemot vērā minimālā iegādes apjoma nosacījumus, kas noteikti GMTN dokumentācijā, kā arī solīto, tai atbilstošo vērtspapīra peļņas likmi. Uzdevumā solītās peļņas likmes solis ir 0,001 procentu punkts.
- 3.7. Konkurējošajā izsolē uzdevumus apmierina, sākot ar mazāko solīto peļņas likmi Valsts kases noteiktā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisijas apjoma un maksimāli pieļaujamās peļņas likmes ietvaros.
- 3.8. Gadījumā, ja konkurējošās izsoles uzdevumu nav iespējams apmierināt pilnībā, to apmierina neizsolītā nominālvērtību apjoma robežās, ņemot vērā minimālā iegādes apjoma nosacījumus, kas noteikti GMTN dokumentācijā. Lai izpildītu emisijas minimālā iegādes apjoma nosacījumus, kas noteikti GMTN dokumentācijā, Valsts kasei ir tiesības mainīt iepriekš Valsts kases rīkojumā izziņoto pārdošanas apjomu.
- 3.9. Gadījumā, ja ir vairāki konkurējošās izsoles uzdevumi ar vienādām solītām peļņas likmēm, kurus nevar apmierināt pilnībā, tos apmierina proporcionāli uzdevumā norādītajam nominālvērtību apjomam, ņemot vērā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisijas apjomu un minimālo iegādes apjomu, kas noteikts GMTN dokumentācijā. Ja pēc šī procesa vēl paliek nepiešķirts vērtspapīru nominālvērtību apjoms, tas tiek piešķirts uzdevumam, kurā norādīts lielākais vērtspapīru nominālvērtību apjoms. Gadījumā, ja divos vai vairāk uzdevumos ir norādīts vienāds vērtspapīru nominālvērtību apjoms, atlikušais vērtspapīru nominālvērtību apjoms tiek piešķirts kādam no šiem uzdevumiem, ievērojot Biržas tirdzniecības sistēmas ģenerētu nejaušības principu.
- 3.10. Konkurējošās izsoles gaitā Birža elektroniskā formā sagatavo izsoles rezultātu kopsavilkumu, kuru līdz konkurējošās izsoles dienas beigām publicē Biržas mājas lapā, iekļaujot saistību atrunu.
- 3.11. Ja Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties izsolē, nav veicis norēķinus par GMTN vērtspapīriem iekšējā tirgū noteiktajā norēķinu dienā, Birža sadarbībā ar Valsts kasi precīzē izsoles rezultātu kopsavilkumu, labojot GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū pārdoto apjomu, bet nemainot pārējo informāciju.

4. VĒRTSPAPĪRU SĀKOTNĒJĀ IZVIETOŠANA FIKSĒTAS LIKMES (NEKONKURĒJOŠĀ) IZSOLĒ

- 4.1. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū izvietošana fiksētas likmes (nekonkurējošā) izsolē (turpmāk – nekonkurējošā izsole) tiek veikta saskaņā ar Valsts kases rīkojumu. Vienā dienā var notikt viena vai vairākas nekonkurējošās izsoles. Nekonkurējošās izsoles ir slēgtas, ja vien Valsts kases rīkojumā nav norādīts citādi.
- 4.2. Valsts kase pirms katras nekonkurējošās izsoles, elektroniski nosūta Biržai Valsts kases rīkojumu par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisiju, kurā norāda informāciju par izsolāmo

GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū raksturlielumiem, kā arī papildus norāda katras nekonkurējošās izsoles datumu, sākuma laiku un laiku, līdz kuram tiek pieņemti pieteikumi, ja nepieciešams, norādot arī citu papildus informāciju. Valsts kase šajā punktā minēto informāciju nosūta Biržai ne vēlāk kā četras darba dienas vai gadījumos, kad ārkārtas apstākļu dēļ Valsts kase nevar ievērot noteikto informācijas iesniegšanas termiņu, ne vēlāk kā līdz plkst. 10.00 iepriekšējā darba dienā pirms katras nekonkurējošās izsoles. Vienlaicīgi Valsts kase nodrošina norādītās informācijas pieejamību Valsts kases mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.

- 4.3. Birža pēc šo noteikumu 4.2. punktā minētā Valsts kases rīkojuma saņemšanas nekavējoties minēto informāciju elektroniskā formā nosūta Biržas biedriem un nodrošina informācijas pieejamību Biržas mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.
- 4.4. Pēc konkurējošās daudz cenu izsoles līdz nekonkurējošās izsoles sākumam Birža publicē Biržas mājas lapā informāciju par nekonkurējošā izsolē izsolāmā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū laidiena peļņas likmi, netīro cenu un fiksētā ienākuma likmi, iekļaujot saistību atrunu.
- 4.5. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū sākotnējo izvietojumu fiksētas likmes apjoma (nekonkurējošā) izsolē veic saskaņā ar šādiem nosacījumiem:
 - 4.5.1. peļņas likmi un pirkšanas cenu nosaka atbilstoši šīs pašas sērijas GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū pēdējā konkurējošajā daudz cenu izsolē noteiktajai vidējai svērtai peļņas likmei un šai likmei atbilstošajai cenai;
 - 4.5.2. fiksētā ienākuma likmi nosaka vienādu ar fiksētā ienākuma likmi, kas piemērota pirmreizēji emitētajiem šīs pašas sērijas GMTN vērtspapīriem.
- 4.6. Nekonkurējošā izsole notiek, ja uz to pieteicies vismaz viens Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties izsolē.
- 4.7. Lai piedalītos nekonkurējošā izsolē, Biržas biedram, kuram ir tiesības piedalīties izsolē, nekonkurējošās izsoles dienā līdz Valsts kases noteiktajam laikam jāiesniedz Biržas tirdzniecības sistēmā vismaz viens uzdevums, ievērojot minimālā iegādes apjoma nosacījumus, kas noteikti GMTN dokumentācijā. Visi nekonkurējošai izsolei iesniegtie uzdevumi līdz Valsts kases noteiktajam laikam var tikt grozīti vai atsaukti.
- 4.8. Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties izsolē, nekonkurējošā izsolē piedalās ar vienu vai vairākiem uzdevumiem, norādot katrā uzdevumā iegādājamo GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū Valsts kases noteikto peļņas likmi un nominālvērtību apjomu, kas nav mazāks par GMTN dokumentācijā noteikto. Biržas biedra uzdevumos norādītais kopējais GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū nominālvērtību apjoms nedrīkst pārsniegt Valsts kases šīs pašas sērijas piedāvāto laidiena apjomu pēdējā konkurējošā izsolē, ja tāds bija norādīts Valsts kases rīkojumā vai Valsts kases šīs pašas sērijas pārdošanā laidiena apjomu pēdējā konkurējošā izsolē (gadījumā, ja Valsts kases rīkojumā nav norādīts piedāvātais apjoms).
- 4.9. Nekonkurējošā izsolē uzdevumus izpilda to iesniegšanas secībā (FIFO princips), ņemot vērā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisijas minimālo pārdošanas apjomu.

- 4.10. Nekonkurējošās izsoles gaitā Birža elektroniskā formā sagatavo izsoles rezultātu kopsavilkumu, kuru līdz nekonkurējošās izsoles dienas beigām publicē Biržas mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.
- 4.11. Ja Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties izsolē, nav veicis norēķinus par GMTN vērtspapīriem iekšējā tirgū noteiktajā norēķinu dienā, Birža sadarbībā ar Valsts kasi precizē izsoles rezultātu kopsavilkumu, labojot GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū pārdoto apjomu, bet nemainot pārējo informāciju.

5. VĒRTSPAPĪRU SĀKOTNĒJĀ IZVIETOŠANA TIEŠAJĀ PĀRDOŠANĀ

- 5.1. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū izvietošana tiešajā pārdošanā tiek veikta saskaņā ar Valsts kases rīkojumu.
- 5.2. Valsts kase ne vēlāk kā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū tiešās pārdošanas dienā vai gadījumā, ja attiecīgās GMTN vērtspapīra sērijas izvietošana Biržas tirdzniecības sistēmā notiek pirmo reizi, ne vēlāk līdz plkst. 13:00 iepriekšējā darba dienā pirms GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū tiešās pārdošanas, elektroniski nosūta Biržai Valsts kases rīkojumu par GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū emisiju, kurā norāda pārdodamā GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū vērtspapīra raksturlielumus, kā arī papildus norāda katras konkurējošās izsoles datumu, sākuma laiku un laiku, līdz kuram tiek pieņemti pieteikumi, ja nepieciešams, norādot arī citu papildus informāciju. Vienlaicīgi Valsts kase nodrošina norādītās informācijas pieejamību Valsts kases mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.
- 5.3. Pēc šo noteikumu 5.2. punktā minētā Valsts kases rīkojuma saņemšanas, Birža nekavējoties, bet ne vēlāk kā līdz tiešās pārdošanas sākumam, elektroniskā formā nosūta minēto informāciju Biržas biedriem un nodrošina informācijas pieejamību Biržas mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.
- 5.4. Lai piedalītos GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū tiešajā pārdošanā, Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties tiešajā pārdošanā, iesniedz Biržas tirdzniecības sistēmā uzdevumu GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū iegādei. Visi tiešajā pārdošanā iesniegtie uzdevumi ir negrozāmi un neatsaucami.
- 5.5. Biržas biedrs, kuram ir tiesības piedalīties tiešajā pārdošanā, tajā piedalās ar vienu vai vairākiem uzdevumiem, norādot tiešajā pārdošanā iegādājamo GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū Valsts kases noteikto cenu un nominālvērtību apjomu.
- 5.6. Biržas biedru, kuri piedalās tiešajā pārdošanā, iesniegtos uzdevumus GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū tiešajā pārdošanā izpilda to iesniegšanas secībā, ņemot vērā minimālo iegādes apjomu.
- 5.7. Pēc GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū tiešās pārdošanas uzdevumu izpildes Birža elektroniskā formā sagatavo tiešās pārdošanas rezultātu kopsavilkumu, kuru līdz vērtspapīru tiešās pārdošanas dienas beigām publicē Biržas mājas lapā internetā, iekļaujot saistību atrunu.

6. VĒRTSPAPĪRU CENAS, UZKRĀTĀ FIKSĒTĀ IENĀKUMA UN PEĻNAS LIKMES APRĒĶINS

- 6.1. Gada bāze cenas, peļņas likmes un uzkrātā fiksētā ienākuma aprēķinam GMTN (Reg S) vērtspapīriem iekšējā tirgū ir Act/Act (aprēķinā lieto faktisko dienu skaitu, par bāzi izmantojot faktisko dienu skaitu gadā), izmantojot Starptautiskās kapitāla tirgus asociācijas (ICMA) standartu, atbilstoši GMTN programmas dokumentācijā rakstītajam.
- 6.2. Aprēķinot GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū cenu, peļņas likmi un uzkrāto fiksēto ienākumu, jāņem vērā šādi nosacījumi (ja vien GMTN programmā nav noteikts savādāk):
- 6.2.1. uzkrātais fiksētais ienākums tiek aprēķināts, noapaļojot to līdz divpadsmit zīmēm aiz komata norēķinu valūtā;
- 6.2.2. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū cena procentos no nominālvērtības tiek aprēķināta, noapaļojot to līdz trim zīmēm aiz komata. Norēķinu apjoms katram darījumam tiek noapaļots līdz divām zīmēm aiz komata norēķinu valūtā;
- 6.2.3. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū cenai jāpieskaita uzkrātais fiksētais ienākums;
- 6.2.4. fiksētā ienākuma procentu likme paliek nemainīga no pirmā GMTN vērtspapīru attiecīgās sērijas laidiena.
- 6.3. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū cenas aprēķina metodes:
- 6.3.1. GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū, kuram noteikta fiksēta ienākuma procentu likme, cenas aprēķina metode saskaņā ar Starptautiskās kapitāla tirgus asociācijas (ICMA) standartu, ir šāda:

GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū kopējā cena (“netīrā cena”, kur tīrajai cenai pieskaita uzkrātos procentus) $K = P + Ac$, kur

$$P = \sum_{i=1}^n \frac{CF_i}{(1 + Y/Fq)^{Li}}, \text{ kur}$$

P - GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū cena bez uzkrātā fiksētā ienākuma (tīrā cena);

n –maksājumu skaits līdz GMTN vērtspapīra dzēšanai.

CF_i - summa, kuru maksā katra maksājuma i-tā perioda beigās;

Y - GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū peļņas likme līdz dzēšanai likme decimāldaļās;

Fq - fiksētā ienākuma maksājumu skaits (biežums) gadā;

Li - fiksētā ienākuma periodu skaits līdz maksājumam i-tā perioda beigās.

$$Li = t - m / k$$

$$Ac = \frac{100 * Fi * m}{Fq * k}, \text{ kur}$$

Ac – uzkrātais fiksētais ienākums;

Fi - fiksētā ienākuma (kupona) gada likme decimāldaļās;

m - faktiskais dienu skaits, par kurām aprēķina uzkrāto fiksēto ienākumu;

- k - faktiskais dienu skaits fiksētā ienākuma periodā, kurā iekrīt aprēķina datums;
- t - fiksētā ienākuma maksājumu skaits laikā līdz maksājumam i-tā perioda beigās.

6.4. Uzkrāto fiksēto ienākumu (uzkrāto kupona maksājumu) aprēķina no fiksētā ienākuma pēdējā norēķina datuma vai sākotnējā laidiena norēķinu datuma (ieskaitot) līdz to pašu GMTN vērtspapīru iekšējā tirgū papildu laidiena norēķina datumam (neieskaitot).

7. NOBEIGUMA NOTEIKUMI

7.1. Šie noteikumi un visi turpmākie to grozījumi stājas spēkā pēc Valsts kases saskaņojuma saņemšanas, Finanšu instrumentu tirgus likumā noteiktajā kārtībā.