

Finanšu instrumentu darījumu līguma

III daļa

Noteikumi valūtu opciju darījumiem



1. Vispārējie noteikumi

Noteikumi valūtu opciju Darījumiem (turpmāk tekstā – Pakalpojuma noteikumi) ir Pakalpojuma noteikumi Līguma, kas noslēgts starp SEB banku un Klientu, izpratnē. Pakalpojuma noteikumi nosaka, cita starpā, Darījuma būtiskos nosacījumus, par kuriem Pusēm jāvienojas, slēdzot valūtu opciju Darījumu, valūtu opciju Darījuma saistību izpildei nepieciešamo Nodrošinājumu un norēķinu kārtības īpašos nosacījumus.

2. Paskaidrojošie termini

Papildus Preambulā, Pamatnoteikumos un Noteikumos noteiktajiem paskaidrojošajiem terminiem, Pakalpojuma noteikumos tiek izmantoti šādi paskaidrojošie termini:

valūtu opciju Darījums (opcija) – Darījums, kas noslēgts starp valūtu opcijas pārdevēju un pircēju, kas dod vienai valūtu opciju Darījuma pusei tiesības, bet neuzliek pienākumu, pirkt no otras puses vai pārdot otrai pusei pamata valūtu par noteiktu cenu noteiktā laika posmā;

pamata valūta – valūta, kura tiek pirktā vai pārdota valūtu opciju Darījuma ietvaros;

cenās valūta – valūta, kurā tiek izteikta valūtu opciju Darījuma izpildes cena;

valūtu opciju Darījuma summa – pamata valūtas summa;

put opcija – valūtu opcijas darījums, kas dod tiesības opcijas turētājam pārdot pamata valūtu;

call opcija – valūtu opcijas darījumu, kas dod tiesības opcijas turētājam pirkt pamata valūtu;

opcijas prēmija – summa, ko opcijas turētājs maksā opcijas pārdevējam par opcijas iegādi;

opcijas izmantošana – pamata valūtas pirkšana vai pārdošana izmantojot opcijā dotās tiesības.

opcijas izpildes cena – attiecīgajai opcijai noteiktā pamata valūtas un cenās valūtas apmaiņas kurss;

opcijas izpildes laiks – brīdis, kurā notiek opcijas izmantošana;

opcijas termiņš – laika periods no opcijas sākuma datuma līdz brīdim, līdz kuram opcijas turētājam ir jāpaziņo opcijas pārdevējam par opcijas izmantošanu;

norēķinu datums – Darba diena, kurā tiek veikti ar valūtu opciju Darījumu saistītie norēķini;

opcijas tirgus vērtība – cenās valūtas summa, kas jāmaksā attiecīgajā brīdī par noteiktās pamata valūtas summas iegūšanu, ja tiek veikta opcijas izmantošana;

valūtu opciju Darījuma vieta – birža, kurā darījums tiek slēgts, vai ārpusbiržas (jeb OTC) tirgus. Darījuma vieta tiek norādīta Paziņojumā par Rikojuma izpildi;

Eiropas stila opcija – opciju var izmantot tikai opcijas termiņa beigās;

Amerikas stila opcija – opciju var izmantot jebkurā opcijas termiņa brīdī;

valūtu maiņas atsauces vai bāzes (reference) kurss – Eiropas Centrālās Bankas interneta vietnē

<http://www.ecb.int/stats/exchange/eurofxref/html/index.en.html> publicētie valūtu maiņas kursi;

lesniegums par kontiem – lesniegums, kurā uzskaitīti Klienta norādītie konti, kuros tiek veikti norēķini par valūtas maiņas darījumiem.

3. Valūtu opciju darījuma riski

Šajā sadaļā ir aprakstīti specifiski ar valūtu opciju Darījumiem saistīti riski, kas papildina pārējo SEB bankas sniegto informāciju par finanšu instrumentu īpašībām un ar tiem saistītajiem riskiem.

3.1 Tirgus risks:

- opcijas izpildes cena var būt sliktāka par opcijas tirgus vērtību opcijas termiņā, tādēļ opcijas turētājs, neizmantojot opciju, zaudē visu samaksāto opcijas prēmiju;
- opcijas tirgus vērtība var būt mazāka par sākotnēji noteikto opcijas prēmiju, tā rezultātā opcijas turētājs, pārdodot opciju var zaudēt visu vai daļu no opcijas prēmijas;
- opcijas atpakaļpārdošana var būt apgrūtināša dažādu opcijas tirdzniecības likviditāti ierobežojošu apstākļu dēļ (cita starpā, nav sekundārais tirgus), kas var aizkavēt vai padarīt neiespējamu opcijas atpakaļpārdošanas darījumu;
- opcijas izpildes cena var būt lielāka par opcijas tirgus vērtības, tādēļ opcijas pārdevējs, opcijas turētājam izmantojot opciju, var ciest zaudējumus, kas var nebūt ierobežoti to apmērā.

3.2 Kredītrisks:

Ja valūtu opciju Darījums tiek slēgts bez Nodrošinājuma:

- opcijas turētājs nesamaksā opcijas prēmiju noteiktajā norēķinu datumā; tā rezultātā opcija ir jāpārdod kādam citam darījuma partnerim par tirgus cenu, kas var izrādīties sliktāka par sākotnēji noteikto;
- opcijas pārdevējs neveic norēķinus pēc opcijas izpildes paziņošanas, kas var radīt zaudējumus, pērkot vai pārdodot pamata valūtu finanšu tirgū.

4. Valūtu opciju darījuma būtiskie nosacījumi

4.1 Valūtu opciju Darījuma būtiskie nosacījumi, vismaz par kuriem Pusēm ir jāvienojas valūtu opciju Darījuma noslēgšanas brīdī:

- opcijas turētājs un opcijas pārdevējs;
- opcijas veida noteikšana (call opcija vai put opcija);
- opcijas stila noteikšana (Eiropas vai Amerikas stila opcija);
- valūtu opciju Darījuma summas pamata valūtā un cenās valūtā;
- opcijas izpildes cena;
- opcijas termiņš;
- opcijas prēmija;
- norēķinu datums un kārtība, Konts, kuru izmantot norēķiniem par valūtu opciju Darījumu un kas būs Attiecīgais konts;
- Nodrošinājuma veidu, apmēru un nosacījumus, ja Klients ir opcijas pārdevējs un ja Nodrošinājums tiek sniegts. Gadījumā, ja Nodrošinājums ir noteikts konkrētā saistību izpildes apmērā, Puses vienojas par Klienta Kontu (piemēram, noguldījuma konts), kas būs Attiecīgais konts, kurā finanšu līdzekļi vai finanšu instrumenti tiks bloķēti par labu SEB bankai no valūtu opciju Darījuma izrietošo saistību izpildes nodrošināšanai.

5. Valūtu opciju darījumu veikšana un norēķini

5.1. Klients pilnvaro SEB banku opcijas prēmiju par valūtu opciju Darījumu noņemt no Klienta Konta vai SEB bankai ir pienākums ieskaitīt opcijas prēmiju Klienta Kontā opcijas prēmijas norēķinu datumā.

5.2 SEB banka opcijas termiņa beigās salīdzina opcijas izpildes cenu ar valūtu maiņas atsauces vai bāzes (reference) kursu:

- ja opcijas izpildes cena opcijas turētājam ir izdevīgāka par valūtu maiņas atsauces vai bāzes kursu, tad SEB bankai ir tiesības uzskatīt, ka opcijas turētājs ir devis rikojumu par opcijas izmantošanu;
- ja opcijas izpildes cena opcijas turētājam ir neizdevīgāka par valūtu maiņas atsauces vai bāzes kursu, tad SEB bankai ir tiesības uzskatīt, ka opcijas turētājs ir devis rikojumu par opcijas izbeigšanu;

5.3 Opcijas izmantošanas gadījumā SEB banka veic norēķinus ar Klientu (t.i. noņem no Klienta Konta un pārskaita Klientam finanšu līdzekļus nepieciešamajā apmērā) atbilstoši noslēgtā valūtu opciju Darījuma nosacījumiem. Opcija tiek uzskatīta par izbeigtu pēc visu norēķinu veikšanas.

5.4 Amerikas stila opcijas turētājs opcijas termiņā var dot opcijas pārdevējam rikojumu par opcijas izmantošanu. Ja Amerikas stila opcijas turētājs opcijas termiņā nav informējis opcijas pārdevēju par opcijas izmantošanu, SEB banka rīkosies saskaņā ar 5.2. punktā noteikto.

5.5 Katrai Pusei ir tiesības piedāvāt otrai Pusei pirkt vai pārdot opciju opcijas termiņa laikā. Šāds darījums var notikt Pusēm vienojoties par opcijas pirkšanas vai pārdošanas darījuma nosacījumiem.

5.6 Pusei nav tiesības opciju un no tās izrietošās tiesības un pienākumus pārdot nodot vai citādi atsavināt trešajai personai bez otras Puses piekrišanas.

5.7 Visi norēķini par valūtu opciju darījumiem tiks veikti kontos, kurus Klients norādīja lesniegumā par Kontiem.

6. Saistību nodrošinājums

6.1. Ja Nodrošinājums ir finanšu līdzekļi un/vai finanšu instrumenti, Nodrošinājuma summu un/vai apmēru nosaka SEB banka parasti Darījuma noslēgšanas brīdī atkarībā no opcijas būtiskajiem nosacījumiem. Klientam ir pienākums Attiecīgajā kontā nodrošināt finanšu līdzekļus vai finanšu instrumentus SEB bankas noteiktajā apmērā un termiņā.

6.2. Ja Darījuma noslēgšanas laikā nav noteikts citādi, SEB banka veic visus norēķinus, kas saistīti ar Nodrošinājumu.