



ABLV

BANKING / INVESTMENTS \ ADVISORY

ABLV Bank, AS

publiskais ceturkšņa pārskats
2016. gada janvāris - marts

Bankas vadības ziņojums

Godātie ABLV Bank, AS akcionāri!

Gada pirmajā ceturksnī pasaules ekonomikā pārsvarā valdīja nogaidošs noskaņojums un mērens optimisms. Saskaņā ar Eiropas Komisijas prognozēm, ekonomiskā izaugsme eirozonā šogad palielināsies līdz 1,7% (pagājušajā gadā – 1,6%) un 2017. gadā varētu sasniegt 1,9%. Savukārt, visas Eiropas Savienības ekonomikas izaugsme šogad saglabāsies stabila 1,9% līmenī un nākošgad pieaugs līdz 2,0%.

Latvijas ekonomika turpina uzrādīt stabilu izaugsmi, kas ir augstāka, nekā prognozēts sākotnēji. 2015. gadā Latvijas ekonomika pieauga par 2,7%, iepriekš prognozēto 2,4% vietā. Šogad Latvijai tiek prognozēta izaugsme 3,1% apmērā. Straujāki izaugsmes tempi ir saistīti ar to, ka Latvijas ekonomika veiksmīgi izmanto globālo konjunktūru — zemās enerģijas cenas un zemās procentu likmes starptautiskajos finanšu tirgos. Komerckbanku sektors sācis aktīvāk kredītēt gan uzņēmumus, gan mājsaimniecības, kas ir svarīgi tautsaimniecības stimulēšanai. Galvenie ekonomikas dzinējspēki ir iekšzemes pieprasījums un investīcijas.

Pirmā ceturkšņa rezultāti ļauj prognozēt, ka 2016. gadam izvirzītos mērķus sasniegsim. Visi svarīgākie bankas darbības rādītāji saglabājas augstā līmenī, tai skaitā, arī kapitāla pietiekamība un likviditāte.

Turpinot obligāciju emisiju programmu, 2016. gada sākumā veicām divas jaunas kupona obligāciju emisijas, kuru kopējais apjoms bija 75 000 000 USD un 20 000 000 EUR pēc nominālvērtības. Obligācijas sākotnējās izvietošanas ietvaros iegādājās vairāk par 190 investoriem. Emisijas notika Piektās obligāciju piedāvājuma programmas ietvaros un tās iekļautas regulētajā tirgū — biržas NASDAQ Riga Parāda vērtspapīru sarakstā.

Banka aktīvi turpināja komerc kredītu izsniegšanu. 2016. gada 1. ceturksnī, salīdzinājumā ar 2015. gada 1. ceturksni, vidējais komerc kredītu portfeļa apjoms pieaudzis par 21%, kopējam komerc kredītu portfeļa apjomam ceturkšņa beigās sasniedzot 462,6 miljonus EUR. Gada pirmā ceturkšņa laikā parakstīti jauni kredīt līgumi par kopējo summu 49,9 miljoni EUR, pārsvarā kredītējot uzņēmumus Latvijā.

Apgūstot jaunus reģionus un vēloties veidot daudz ciešākas attiecības ar saviem biznesa partneriem, ABLV grupas uzņēmums ABLV Advisory Services, SIA pārskata periodā atvēra pārstāvniecību pasaules finanšu lielvalstī — Amerikas Savienotajās Valstīs. Pārstāvniecības Ņujorkā darbs būs vērsts uz savstarpēji izdevīgu starptautisku biznesa kontaktu veidošanu ABLV grupas uzņēmumiem, kā arī uz normatīvi tiesiskās regulēšanas vides izpēti ASV. Šobrīd ABLV grupa ir pārstāvēta 10 ārvalstīs — tai ir 12 pārstāvniecības dažādās pasaules pilsētās un meitas banka Luksemburgā ABLV Bank Luxembourg, S.A.

Situācija finanšu tirgos kopumā un mūsu mērķa reģionos, kā arī dažādu uzraudzības institūciju prasību pieaugums neļauj šogad cerēt uz tikpat strauju biznesa pieaugumu kā iepriekšējos gados, bet, tā kā mūsu biznesa modelis ir efektīvs un risku vadība — stingra un pārdomāta, rezultātus var prognozēt aptuveni 2015. gada līmenī. 2016. gadā plānojam saglabāt tiros komisijas ienākumus un peļņu iepriekšējā gada līmenī. Plānojam izsniegt arī jaunus komerc kredītus, finansējot lielus biznesa projektus. 2016. gada tīrā peļņa plānota aptuveni 2015. gada līmenī.

Finanšu rezultāti

Bankas 2016. gada pirmā ceturkšņa finanšu rādītāji liecina par izaugsmes turpināšanos:

- Bankas peļņa 2016. gada pirmajā ceturksnī bija 21,5 miljoni EUR. Salīdzinoši 2015. gada 1. ceturksnī – 20,1 miljons EUR.
- Bankas pamatdarbības ienākumi – 35,6 miljoni EUR. Salīdzinājumā ar 2015. gada 1. ceturksni pamatdarbības ienākumi ir auguši par 4,7%.
- Bankas noguldījumu apjoms 2016. gada 31. martā bija 3,56 miljardi EUR.
- Emitēto parāda vērtspapīru apjoms sasniedza 562,6 miljonus EUR.
- Bankas aktīvu apjoms 2016. gada 31. martā bija 4,68 miljardi EUR.
- Bankas kredītportfeļa apjoms marta beigās bija 899,8 miljoni EUR.
- Bankas kapitāls un rezerves – 243,8 miljoni EUR.
- Bankas kapitāla pietiekamības līmenis 2016. gada 31. martā bija 16,31%, bet likviditātes līmenis – 81,61%.
- Kapitāla atdeves rādītājs ROE 2016. gada 31. martā bija 30,83%, bet aktīvu atdeves rādītājs ROA – 1,80%.

2016. gada 7. aprīlī notika bankas kārtējā akcionāru sapulce. Sapulcē tika apstiprināts bankas gada pārskats un konsolidētais gada pārskats par 2015. gadu. Akcionāru sapulce apstiprināja valdes priekšlikumu par 2015. gada peļņas izlietošanu, saskaņā ar kuru 68,8 miljoni EUR tika izmaksāti dividendēs, par vienu bankas akciju dividenžu apmērs bija 1,95 EUR.

Banka turpināja veikt ieguldījumus vērtspapīros. Kopējais vērtspapīru portfeļa apjoms 2016. gada 31. martā bija 2,51 miljards EUR. Gandrīz visu bankas vērtspapīru portfeli veido parāda vērtspapīri ar fiksētu ienākumu, 70,6 % no portfeļa ir vērtspapīri ar kredītreitingu AA- un augstāku. Sadalījums pa galvenajām valstīm ir šāds: : ASV — 31,0%, Vācija — 14,7%, Latvija — 11,7%, Krievija — 8,9%, Kanāda — 8,2%, Zviedrija — 5,7%, Nīderlande — 2,2%. Papildus 3,8% veido starptautisko institūciju emitētie vērtspapīri. Vērtspapīru portfeļa gada ienesīgums pārskata periodā bija 3,5%.

Izsakām pateicību mūsu akcionāriem un klientiem par izrādīto uzticību, un visiem mūsu darbiniekiem – par ieguldījumu bankas un koncerna izaugsmes veidošanā!



Padomes priekšsēdētājs
Oļegs Fiļs



Valdes priekšsēdētājs
Ernests Bernis

Rīgā, 2016. gada 27. maijā

Pamatinformācija

ABLV Bank, AS (turpmāk tekstā – banka) tika reģistrēta kā akciju sabiedrība Aizkrauklē, vienotais reģistrācijas Nr. 50003149401, Latvijas Republikā 1993. gada 17. septembrī. Šobrīd bankas juridiskā adrese ir Rīga, Elizabetes iela 23.

Banka darbojas saskaņā ar Latvijas Republikas normatīvajiem aktiem un Finanšu un kapitāla tirgus komisijas izsniegto licenci, kas ļauj veikt visus Kredītiestāžu likumā paredzētos finanšu pakalpojumus.

2016. gadā 31. martā koncernam un bankai ir centrālais birojs un viens kredītu centrs Rīgā. Būtiskākās bankas meitas sabiedrības ir ABLV Bank Luxembourg S.A., ABLV Asset Management, IPAS, ABLV Capital Markets, IBAS, Pillar Holding Company, KS. Koncernam ir pārstāvniecības/ teritoriālās struktūrvienības Azerbaidžānā (Baku), Baltkrievijā (Minskā), Kazahstānā (Almata), Kiprā (Limasolā), Krievijā (Maskavā, Sanktpēterburgā un Vladivostokā), Ukrainā (pārstāvniecība Kijevā, kā arī atsevišķs pārstāvniecības birojs Odesā), Uzbekistānā (Taškentā), Ņujorkā (ASV) un Honkongā.

ABLV Bank, AS organizatoriskā struktūra atspoguļota šī publiskā ceturkšņa pārskata 5. lappusē.

Šis publiskais ceturkšņa pārskats ir sagatavots saskaņā ar Finanšu kapitāla un tirgus komisijas Kredītiestāžu publisko ceturkšņa pārskatu sagatavošanas normatīvajiem noteikumiem ar mērķi sniegt informāciju par bankas finansiālo stāvokli un darbības rādītājiem par periodu no 2016. gada 1. janvāra līdz 2016. gada 31. martam.

Finanšu pārskati ir uzrādīti tūkstošos eiro (EUR'000), ja vien nav norādīts citādi. Finanšu pārskatos iekavās sniegtā informācija atbilst salīdzinošiem finanšu rādītājiem par 2015. gada 31. decembri vai par 2015. gada pirmo ceturksni.

Bankas akcionāri un saistīto akcionāru grupas

	31.03.2016.		31.12.2015.	
	Akcijas nominālvērtība	Balsstiesīgās akcijas	Akcijas nominālvērtība	Balsstiesīgās akcijas
Akcionāri	EUR	skaits	EUR	skaits
Ernests Bernis un Nika Berne (tieši un netieši iegūta līdzdalība)	1	13,702,131	1	13,702,131
Oļegs Fiļs (netieši iegūta līdzdalība)	1	13,702,131	1	13,702,131
Pārējie akcionāri kopā	1	4,365,738	1	4,365,738
Akcijas ar balsstiesībām kopā	x	31,770,000	x	31,770,000
Akcijas bez balsstiesībām (personāla akcijas)	1	3,530,000	1	3,530,000
Pamatkapitāls kopā	x	35,300,000	x	35,300,000

Bankas darbības rādītāji

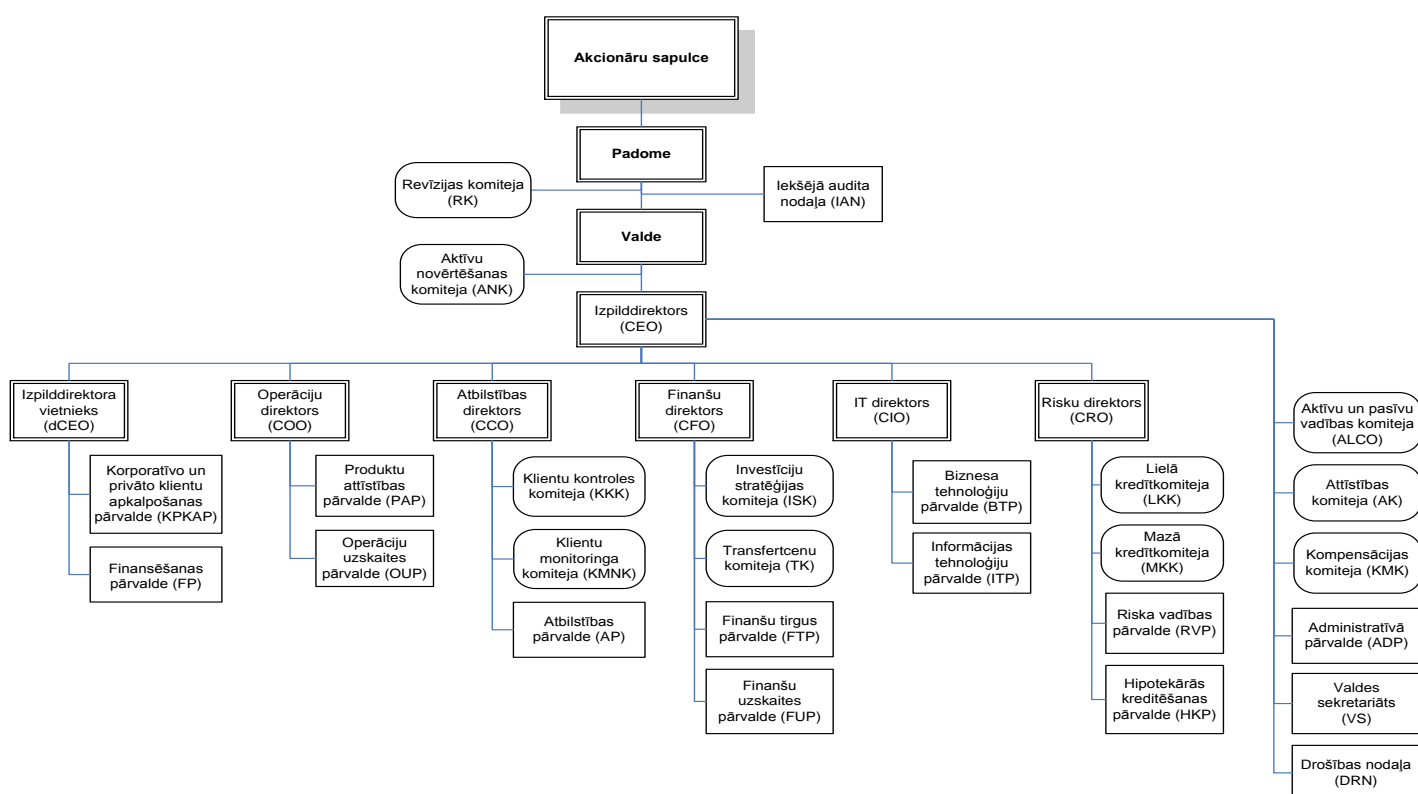
Pozīcijas nosaukums	01.01.2016. - 31.03.2016.	01.01.2015. - 31.03.2015.
	(neauditēts)	(neauditēts)
Kapitāla atdeves rādītājs (ROE) (%)	30.83	36.05
Aktīvu atdeves rādītājs (ROA) (%)	1.80	1.78

Rādītāji aprēķināti saskaņā ar FKTK Kredītiestāžu publisko ceturkšņa pārskatu sagatavošanas normatīvajos noteikumos definētajiem principiem.

Risku vadība

Ar informāciju par riska vadību var iepazīties tīmekļa vietnē <http://www.ablv.com/lv/about/financial-reports>
ABLV Bank, AS Konsolidētais finanšu pārskats par 2015. gadu no 34. līdz 37. pielikumam.

Bankas struktūra*



* - Sīkāka informācija par klientu apkalpošanas vietām pieejama bankas tīmekļa vietnē <http://www.ablv.com/lv/about/offices>.

Bankas padomes un valdes sastāvs

Bankas padome:

Padomes priekšsēdētājs:
Oļegs Fiļs

Atkārtoti ievēlēts ar:
01.04.2013.

Padomes priekšsēdētāja vietnieks:
Jānis Krīgers

Atkārtoti ievēlēts ar:
01.04.2013.

Padomes loceklis:
Igoris Rapoportis

Atkārtoti ievēlēts ar:
01.04.2013.

Bankas valde:

Valdes priekšsēdētājs:
Ernests Bernis - izpilddirektors (CEO)

Atkārtoti ievēlēts ar:
01.05.2014.

Valdes priekšsēdētāja vietnieks:
Vadims Reinfelds – izpilddirektora vietnieks (dCEO)

Atkārtoti ievēlēts ar:
01.05.2014.

Valdes locekļi:
Aleksandrs Pāže – atbilstības direktors (CCO)
Edgars Pavlovičs – risku direktors (CRO)
Māris Kannenieks – finanšu direktors (CFO)
Rolands Citajevs – IT direktors (CIO)
Romans Surnačovs – operāciju direktors (COO)

Atkārtoti ievēlēts ar:
01.05.2014.
01.05.2014.
01.05.2014.
01.05.2014.
01.05.2014.

Pārskata perioda laikā bankas padomes un valdes sastāvā nav notikušas nekādas izmaiņas.

Bankas darbības stratēģija un mērķi

Bankas galvenie darbības virzieni ir ieguldījumu pakalpojumi, norēķinu produkti, finanšu resursu pārvaldīšana, finanšu konsultācijas un nekustamā īpašuma pārvaldīšana. Bankas izvēlētais biznesa modelis ir orientēts uz turīgu klientu un viņiem piederošu uzņēmumu individuālu apkalpošanu.

Bankas vīzija

Bankas vīzija ir kļūt par vadošo neatkarīgo privāto banku Austrumeiropā un pirmo, kas apvienos tradicionālos bankas pakalpojumus, aktīvu pārvaldi un konsultācijas savu klientu vajadzībām pielāgotā vienotā pakalpojumu piedāvājumā.

Bankas misija

Bankas misija ir saglabāt un vairot mūsu klientu kapitālu, sniedzot viņiem šim nolūkam nepieciešamos finanšu pakalpojumus un konsultācijas.

Bankas vērtības

Pretimnākošs

Mēs uzmanīgi klausāmies, piedāvājam saprātīgus risinājumus un vienmēr esam gatavi pārmaiņām. Mēs nestāvam uz vietas, mēs darbojamies.

Intuitīvs

Mēs saprotam, kas ir svarīgs mūsu klientiem. Mēs izprotam klienta biznesa, valsts likumu un kultūras īpatnības un piedāvājam individuāli piemērotus risinājumus.

Vērtīgs

Mēs strādājam, lai klienti gūtu panākumus. Mūsu darbībā galvenais ir būt vērtīgiem mūsu klientiem.

Bankas mērķis

Bankas mērķis ir panākt, lai vidēji lieli privāti uzņēmumi un turīgas privātpersonas Baltijā un NVS valstīs izvēlētos ABLV Bank, AS, kā primāro finanšu partneri un konsultantu.

Konsolidācijas grupas sastāvs

Šajā publiskajā ceturkšņa pārskatā konsolidācijas grupas (turpmāk – koncerns) sastāvs ir noteikts atbilstoši Finanšu kapitāla un tirgus komisijas Kredītiestāžu publisko ceturkšņa pārskatu sagatavošanas normatīvajiem noteikumiem. ABLV Bank, AS ir koncerna mātes uzņēmums.

Koncerna* sastāvs 2016. gada 31. martā:

Nr.	Komerccabiedrības nosaukums	Reģistrācijas numurs	Reģistrācijas vietas kods un adrese	Komerccabiedrības veids ¹	Daļa pamatkapitālā (%)	Balssstiesību daļa komercsabiedrībā (%)	Pamatojums iekļaušanai grupā ²
1	ABLV Bank, AS	50003149401	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	BNK	100	100	MT
2	ABLV Bank Luxembourg, S.A.	B 162048	LU, Boulevard Royal, 26a, L-2449, Luxembourg	BNK	100	100	MS
3	ABLV Capital Markets, IBAS	40003814705	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	IBS	90	100	MS
4	ABLV Asset Management, IPAS	40003814724	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	IPS	90	100	MS
5	ABLV Private Equity Management, SIA	40103286757	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	CFI	100	100	MS
6	PEM 1, SIA	40103551353	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
7	ABLV Private Equity Fund 2010, KS	40103307758	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	CFI	100	100	MS
8	ABLV Corporate Services Holding Company, SIA	40103799987	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MS
9	Pillar, SIA	40103554468	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MS
10	Pillar Holding Company, KS	40103260921	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MS
11	Pillar 3, SIA	40103193067	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
12	Pillar 4 & 6, SIA	40103210494	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
13	Pillar 7 & 8, SIA	40103240484	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
14	Pillar 9, SIA	40103241210	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
15	Pillar 11, SIA	40103258310	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
16	Pillar 2, 12 & 14, SIA	50103313991	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
17	Pillar 18, SIA	40103492079	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
18	Pillar 19, SIA	40103766952	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
19	Pillar 20, SIA	40103903056	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
20	Pillar 21, SIA	40103929286	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
21	Pillar 22, SIA	50103966301	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	100	100	MMS
22	Pillar Investment Group, SIA	50003831571	LV, Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010	PLS	91.6	91.6	MMS
23	New Hanza City, SIA	40103222826	LV, Pulkveža Brieža iela 28, Rīga, LV-1045	PLS	100	100	MS
24	NHC Utilities, SIA	40103693339	LV, Pulkveža Brieža iela 28, Rīga, LV-1045	PLS	100	100	MMS

¹ - BNK – banka, IBS – ieguldījumu brokeru sabiedrība, IPS – ieguldījumu pārvaldes sabiedrība, CFI – cita finanšu iestāde, PLS – palīgpakalpojumu uzņēmums.

² - MS – meitas sabiedrība, MMS - meitas sabiedrības meitas sabiedrība, MT – mātes sabiedrība.

*- Koncerna sastāvs atbilst Regulas (ES) Nr.575/2013 prasībām, atšķirības ar SFPS prasībām ir norādītas Informācijas atklāšanas paziņojumā bankas tīmekļa vietnē www.ablv.com.

Bankas peļņas vai zaudējumu aprēķins

Pozīcijas nosaukums	EUR'000	
	01.01.2016. - 31.03.2016. (neauditēts)	01.01.2015. - 31.03.2015. (neauditēts)
Procentu ienākumi	21,441	19,903
Procentu izdevumi	(6,415)	(5,266)
Dividenžu ienākumi	5,218	2,831
Komisijas naudas ienākumi	11,730	13,114
Komisijas naudas izdevumi	(3,225)	(3,669)
Neto realizētā peļņa/ zaudējumi no amortizētajā iegādes vērtībā vērtētajiem finanšu aktīviem un finanšu saistībām	-	-
Neto realizētā peļņa/ zaudējumi no pārdošanai pieejamajiem finanšu aktīviem	(68)	722
Neto peļņa/ zaudējumi no tirdzniecības nolūkā turētajiem finanšu aktīviem un finanšu saistībām	1,346	802
Neto peļņa/zaudējumi no klasificētiem kā patiesajā vērtībā vērtētajiem finanšu aktīviem un finanšu saistībām ar atspoguļojumu peļņas vai zaudējumu aprēķinā	-	-
Patiesās vērtības izmaiņas riska ierobežošanas uzskaitē	-	-
Ārvalstu valūtu tirdzniecības un pārvērtēšanas peļņa/ zaudējumi	4,740	5,337
Īpašuma, iekārtu un aprīkojuma, ieguldījumu īpašuma un nemateriālo aktīvu atzīšanas pārtraukšanas peļņa/zaudējumi	3	6
Pārējie ienākumi	908	1,006
Pārējie izdevumi	(337)	(333)
Administratīvie izdevumi	(12,342)	(11,995)
Nolietojums	(829)	(812)
Uzkrājumu veidošanas rezultāts	-	-
Vērtības samazināšanās zaudējumi	220	(486)
Peļņa/ (zaudējumi) pirms uzņēmumu ienākuma nodokļa aprēķināšanas	22,390	21,160
Uzņēmumu ienākuma nodoklis	(884)	(1,085)
Pārskata perioda peļņa/ (zaudējumi)	21,506	20,075

Bankas bilances pārskats

	EUR'000	
	31.03.2016.	31.12.2015.
Aktīvi	(neauditēts)	(auditēts)*
Kase un prasības uz pieprasījumu pret centrālajām bankām	368,808	448,187
Prasības uz pieprasījumu pret kredītiestādēm	545,014	325,653
Tirdzniecības nolūkā turēti finanšu aktīvi	20,013	22,407
Klasificēti kā patiesajā vērtībā novērtētie finanšu aktīvi ar atspoguļojumu peļņas vai zaudējumu aprēķinā	-	-
Pārdošanai pieejamie finanšu aktīvi	1,563,044	1,780,554
Kredīti un debitoru parādi	1,060,022	1,219,618
<i>Kredīti nebankām</i>	899,758	873,499
<i>Prasības uz termiņu pret kredītiestādēm</i>	160,264	346,119
Līdz termiņa beigām turēti ieguldījumi	926,281	965,253
Pret procentu risku ierobežotās portfeļa daļas patiesās vērtības izmaiņas	-	-
Uzkrātie ienākumi un nākamo periodu izdevumi	1,485	1,238
Pamatlīdzekļi	9,870	9,529
Ieguldījumu īpašums	25,066	25,069
Nemateriālie aktīvi	5,802	6,036
Ieguldījumi radniecīgo un asociēto uzņēmumu pamatkapitālā	120,039	120,036
Nodokļu aktīvi	3,735	3,042
Pārējie aktīvi	26,727	1,499
Kopā aktīvi	4,675,906	4,928,121
Saistības		
Saistības pret centrālajām bankām	180,099	180,072
Saistības uz pieprasījumu pret kredītiestādēm	31,646	63,294
Tirdzniecības nolūkā turētas finanšu saistības	256	482
Klasificētas kā patiesajā vērtībā novērtētās finanšu saistības ar atspoguļojumu peļņas vai zaudējumu aprēķinā	-	-
Amortizētajā iegādes vērtībā vērtētās finanšu saistības	4,134,845	4,366,864
<i>Noguldījumi</i>	3,557,366	3,793,192
<i>Emitētie parastie vērtspapīri</i>	441,983	437,293
<i>Emitētie subordinētie vērtspapīri</i>	120,631	121,118
<i>Subordinētie depozīti</i>	14,865	15,261
<i>Termiņsaistības pret kredītiestādēm</i>	-	-
Finanšu aktīvu nodošanas rezultātā radušās finanšu saistības	-	-
Pret procentu risku ierobežotās portfeļa daļas patiesās vērtības izmaiņas	-	-
Uzkrātie izdevumi un nākamo periodu ienākumi	10,661	8,816
Uzkrājumi	-	-
Nodokļu saistības	1,076	1,001
Pārējās saistības	73,547	26,139
Kopā saistības	4,432,130	4,646,668
Kapitāls un rezerves	243,776	281,453
Kopā kapitāls un rezerves un saistības	4,675,906	4,928,121
Ārpusbilances posteņi		
Iespējamās saistības	8,412	9,516
Ārpusbilances saistības pret klientiem	71,987	68,907

*- Informācija ir sagatavota pamatojoties uz datiem, kas ir pieejami SIA KPMG Baltics (VRN 40003235171) auditētajos pārskatos par 2015. gadu.

Pašu kapitāla un kapitāla pietiekamības rādītāju aprēķina kopsavilkuma pārskats

Kods Pozīcijas nosaukums	EUR'000	
	31.03.2016. (neauditēts)	31.12.2015. (auditēts)*
1. Pašu kapitāls	325,704	321,003
1.1 Pirmā līmeņa kapitāls	207,850	200,680
1.1.1 Pirmā līmeņa pamata kapitāls	207,850	200,680
1.1.2 Pirmā līmeņa papildu kapitāls	-	-
1.2. Otrā līmeņa kapitāls	117,854	120,323
2. Kopējā riska darījumu vērtība	1,997,211	1,859,071
2.1. Riska darījumu riska svērtā vērtība kredīriskam, darījumu samazinājuma riskam un neapmaksātās piegādes riskam	1,684,102	1,570,282
2.2. Kopējā riska darījumu vērtība norēķiniem/iegādei	-	-
2.3. Kopējā riska darījumu vērtība pozīcijas riskam, ārvalstu valūtas riskam un preču riskam	92,972	90,417
2.4. Kopējā riska darījumu vērtība operacionālajam riskam	220,011	198,336
2.5. Kopējā riska darījumu vērtība kredīta vērtības korekcijai	126	36
2.6. Kopējā riska darījumu vērtība, kas saistīta ar lielajiem riska darījumiem tirdzniecības portfeli	-	-
2.7. Citas riska darījumu vērtības	-	-
3. Kapitāla rādītāji un kapitāla līmeņi		
3.1. Pirmā līmeņa pamata kapitāla rādītājs	10.41%	10.79%
3.2. Pirmā līmeņa pamata kapitāla pārpalikums (+)/ deficīts (-)	117,976	117,022
3.3. Pirmā līmeņa kapitāla rādītājs	10.41%	10.79%
3.4. Pirmā līmeņa kapitāla pārpalikums (+)/deficīts (-)	88,018	89,136
3.5. Kopējais kapitāla rādītājs	16.31%	17.27%
3.6. Kopējais kapitāla pārpalikums (+)/ deficīts (-)	165,928	172,278
4. Kopējo kapitāla rezervju prasība	2.50	2.50
4.1. Kapitāla saglabāšanas rezerve (%)	2.50	2.50
4.2. Iestādei specifiskā pretcikliskā kapitāla rezerve (%)	0	-
4.3. Sistēmiskā riska kapitāla rezerve (%)	-	-
4.4. Sistēmiski nozīmīgas iestādes kapitāla rezerve (%)	-	-
4.5. Citas sistēmiski nozīmīgas iestādes kapitāla rezerve (%)	-	-
5. Kapitāla rādītāji, ņemot vērā korekcijas		
5.1. Uzkrājumu vai aktīvu vērtības korekcijas apmērs, piemērojot speciālo politiku pašu kapitāla aprēķina vajadzībām	-	-
5.2. Pirmā līmeņa pamata kapitāla rādītājs, ņemot vērā 5.1. rindā minētās korekcijas apmēru	10.41%	10.79%
5.3. Pirmā līmeņa kapitāla rādītājs, ņemot vērā 5.1. rindā minētās korekcijas apmēru	10.41%	10.79%
5.4. Kopējais kapitāla rādītājs, ņemot vērā 5.1. rindā minētās korekcijas apmēru	16.31%	17.27%

*- Informācija ir sagatavota pamatojoties uz datiem, kas ir pieejami SIA KPMG Baltics (VRN 40003235171) auditētajos pārskatos par 2015. gadu.

Likviditātes rādītāja aprēķins

	EUR'000	
	31.03.2016.	31.12.2015.
	(neauditēts)	(auditēts)*
Likvidie aktīvi		
Kase	10,703	9,659
Prasības pret Latvijas Banku	318,460	398,018
Prasības pret maksātspejīgām kredītiestādēm	666,369	633,344
Likvidie vērtspapīri	1,921,299	2,150,033
Kopā likvidie aktīvi	2,916,831	3,191,054
Tekošās saistības (ar atlikušo termiņu līdz 30 dienām)		
Saistības pret kredītiestādēm	31,646	61,461
Noguldījumi	3,498,478	3,748,369
Emitētie parāda vērtspapīri	-	-
Nauda ceļā	555	3,247
Pārējās tekošās saistības	36,265	40,868
Ārpusbilances saistības	7,342	5,725
Kopā tekošās saistības	3,574,286	3,859,670
Likviditātes rādītājs (%)	81.61	82.68
Minimālais likviditātes rādītājs (%)	30.00	30.00

*- Informācija ir sagatavota pamatojoties uz datiem, kas ir pieejami SIA KPMG Baltics (VRN 40003235171) auditētajos pārskatos par 2015. gadu.

Bankas ieguldījumi finanšu instrumentos, izņemot atvasinātos finanšu instrumentus

Bankas ieguldījumu finanšu instrumentos atspoguļojums valstu griezumā 2016. gada 31. martā, izņemot atvasinātos finanšu instrumentus:

	EUR'000			
Emiteņa valsts	Centrālo valdību vērtspapīri	Citu emitentu vērtspapīri	Kopā	% pret pašu kapitālu
Amerikas Savienotās Valstis	764,993	12,120	777,113	238.6
Vācija	10,066	358,554	368,620	113.2
Latvija	266,437	27,050	293,487	90.1
Krievija	23,455	199,587	223,042	68.5
Kanāda	92,616	113,894	206,510	63.4
Zviedrija	93,535	48,384	141,919	43.6
Nīderlande	-	56,400	56,400	17.3
Norvēģija	35,225	8,937	44,162	13.6
Somija	26,497	8,809	35,306	10.8
Pārējo valstu vērtspapīri*	115,981	149,862	265,843	81.6
Starptautisko institūciju vērtspapīri	-	96,305	96,305	29.6
Neto vērtspapīru portfelis	1,428,805	1,079,902	2,508,707	

* - Vienas valsts emitentu kopējais atlikums ir mazāks par 10% no kapitāla, kas tiek izmantots kapitāla pietiekamības rādītāja aprēķina vajadzībām.

2016. gada 31. martā vērtspapīru portfeļa vidējā svērtā modificētā durācija bija 2,4 (2,5).

Pārskata periodā pārdošanai pieejamiem finanšu instrumentiem netika atzīts vērtības samazinājums. Tāpat vērtības samazinājums pārdošanai pieejamiem finanšu instrumentiem netika atzīts 2015. gada pirmajā ceturksnī.

Pārskata periodā amortizētajā iegādes vērtībā vērtētiem finanšu instrumentiem tika izveidoti uzkrājumi 25,7 tūkstošu EUR apmērā, savukārt 2015. gada pirmajā ceturksnī amortizētajā iegādes vērtībā vērtētiem finanšu instrumentiem netika izveidoti uzkrājumi.

Pārskata perioda beigās amortizētajā iegādes vērtībā vērtētiem finanšu instrumentiem izveidoto uzkrājumu apmērs bija 2,4 (2,6) miljoni EUR un to tirgus vērtība bija 2,3 (2,8) miljoni EUR.

Bankas ieguldījumu finanšu instrumentos atspoguļojums valstu griezumā 2015. gada 31. decembrī, izņemot atvasinātos finanšu instrumentus:

EUR'000				
Emitenta valsts	Centrālo valdību vērtspapīri	Citu emitentu vērtspapīri	Kopā	% pret pašu kapitālu
Amerikas Savienotās Valstis	972,810	16,848	989,658	308.3
Vācija	10,015	384,181	394,196	122.8
Latvija	241,024	31,047	272,071	84.8
Krievija	25,095	198,071	223,166	69.5
Kanāda	96,500	118,395	214,895	66.9
Zviedrija	95,365	62,067	157,432	49.0
Nīderlande	-	58,537	58,537	18.2
Norvēģija	41,355	9,277	50,632	15.8
Somija	32,201	9,220	41,421	12.9
Pārējo valstu vērtspapīri*	110,566	162,143	272,709	85.0
Starptautisko institūciju vērtspapīri	-	93,376	93,376	29.1
Neto vērtspapīru portfelis	1,624,931	1,143,162	2,768,093	

* - Vienas valsts emitentu kopējais atlikums ir mazāks par 10% no kapitāla, kas tiek izmantots kapitāla pietiekamības rādītāja aprēķina vajadzībām.

Notikumi pēc bilances datuma

2016. gada 26. maijā ABLV Bank noslēdza administratīvo līgumu ar Finanšu un kapitāla tirgus komisiju (FKTK). FKTK pēc pārbaūžu rezultātiem bija secinājusi, ka banka iepriekšējos gados atsevišķos gadījumos nav pievērsusi pietiekami lielu uzmanību klientu veikto darījumu uzraudzībai, tiesiskā mērķa pārbaudei un dokumentēšanai. ABLV Bank un FKTK vienojās par izlīgumu un administratīvās lietas izbeigšanu. FKTK piemēroja bankai sodu samazinātā apmērā - 3,17 milj. EUR apmērā, kā arī izteica brīdinājumu atbildīgajam valdes loceklim, vienlaikus atzīstot, ka šobrīd ABLV Bank izpilda visas regulējošās prasības un ir būtiski uzlabojusi iekšējās kontroles sistēmu. Savukārt banka apņēmas turpināt uzlabot iekšējās kontroles sistēmu atbilstoši FKTK ieteikumiem, atvēlot minētajam mērķim ne mazāk kā 6,5 milj. EUR. Banka ir arī atteikusies no daļas klientu, kuru apkalpošana pie pašreizējām prasībām var radīt nesamērīgu risku, un turpina klientu stingru izvērtēšanu.