

Anhang

Tabelle 1: Meldung der Deltaäquivalente

Bezeichnung Klasse von Options- preismodellen	Brutto-Deltaäquivalent		Netto-Delta- äquivalent
	positive Delta- Faktoren	negative Delta- Faktoren	
Klasse ₁	Δ Brutto/positiv, 1	Δ Brutto/negativ, 1	Δ Netto, 1
Klasse ₂	Δ Brutto/positiv, 2	Δ Brutto/negativ, 2	Δ Netto, 2
...
Klasse _n	Δ Brutto/positiv, n	Δ Brutto/negativ, n	Δ Netto, n

Für jede Klasse sind nur diejenigen Optionen in Tabelle 1 zu berücksichtigen, für die ein Institut eine aufsichtliche Genehmigung für die eigene Berechnung des Delta-Faktors benötigt.