

Чистая опционная позиция

1.8. Чистая опционная позиция рассчитывается как разность между требованиями и обязательствами в одной и той же иностранной валюте и одном и том же драгоценном металле, обусловленными покупкой-продажей кредитной организацией опционов. В расчет чистой опционной позиции указанные требования и обязательства включаются в величине, равной произведению текущей рыночной стоимости базисного (базового) актива опциона, выраженной в иностранной валюте или драгоценном металле, и коэффициента Дельта. Опционы с премией в размере до 0,001 процента стоимости базисного (базового) актива опциона в расчет чистой опционной позиции не включаются

Источник: Инструкция Банка России от 15.07.2005 № 124-И (редакция от 28.04.2012) "Об установлении размеров (лимитов) открытых валютных позиций, методике их расчета и особенностях осуществления надзора за их соблюдением кредитными организациями" (Зарегистрировано в Минюсте России 05.08.2005 № 6889)

Источник: <https://alexeyborisov.ru/enc/15274/>