

Anl. 1 4. DeRiMV Einfache Derivate

4. DeRiMV - 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung

© Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 13.08.2026

1. A.1.Futures

1. A.1.1.Anleihenfuture:

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size) * Marktwert der cheapest-to-deliver (CTD)-Referenz-Anleihe

1. A.1.2.Zinsfuture (Interest Rate Future):

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size)

1. A.1.3.Währungsfuture (Currency Future):

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size)

1. A.1.4.Aktienfuture:

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size) * Marktwert der zugrundeliegenden Aktie

1. A.1.5.Indexfuture:

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size) * Index Level

1. A.2.Plain Vanilla Optionen (gekaufte/verkaufte Puts und Calls)

1. A.2.1.Plain Vanilla Anleiheoption:

Vertragswert (notional contract value) * Marktwert der zugrundeliegenden Referenz-Anleihe * Delta

1. A.2.2.Plain Vanilla Aktienoption:

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size) * Marktwert der zugrundeliegenden Aktie * Delta

1. A.2.3.Plain Vanilla Zinsoption:

Vertragswert (notional contract value) * Delta

1. A.2.4.Plain Vanilla Währungsoption:

Vertragswert der Währungspaare * Delta

1. A.2.5.Plain Vanilla Indexoption:

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size) * Index Level * Delta

1. A.2.6.Plain Vanilla Optionen auf Futures:

Anzahl der Verträge * Kontraktgröße (notional contract size) * Marktwert der zugrundeliegenden Basiswerte * Delta

1. A.2.7.Plain Vanilla Swaption:

Referenz Swap Commitment Umrechnungswert (gemäß A.3.) * Delta

1. A.2.8.Optionsscheine und vergleichbare Rechte:

Anzahl der Aktien oder Anleihen * Marktwert der zugrundeliegenden Basiswerte * Delta

1. A.3.Swaps

1. A.3.1.Plain Vanilla Fixed/Floating Rate Zinsen und Inflation Swaps:

Marktwert des Basiswerts

1. A.3.2.Währungs-Swap:

Nominalwert der Währungskomponente(n)

1. A.3.3.Zins/Währungsswaps:

Nominalwert der Währungskomponente(n) oder Währungspaare

1. A.3.4.Total Return Swap:

Marktwert des zugrundeliegenden Basiswerts

1. A.3.5.Non-Basic Total Return Swap (TRS):

Marktwert der beiden zugrundeliegenden Komponenten des TRS

1. A.3.6.Single Name Credit Default Swap:

Protection Seller: Den höheren Wert des Marktwerts des zugrundeliegenden Basiswerts oder des

Nominalwerts des Credit Defaults SwapProtection Buyer: Marktwert des zugrundeliegenden Basiswerts

1. A.3.7.Contract for Differences:

Anzahl der Aktien oder Anleihen * Marktwert des zugrundeliegenden Basiswerts

1. A.4.Forwards

1. A.4.1.FX Forwards:

Nominalwert der Währungskomponente(n)

1. A.4.2.Forward Rate Agreement:

Nominalwert

1. A.5.Leveraged Exposure betreffend Indizes oder Indizes mit eingebettetem Leverage:Ein Derivat, das ein gehebeltes Exposure zu einem Index besitzt und ein Index mit eingebautem Hebel müssen die jeweils zutreffenden Commitment-Umrechnungsformeln für die zugrundeliegenden Basiswerte verwenden.

Eingebettete Derivate

1. B.1.Wandelanleihe:Anzahl der betreffenden Aktien * Marktwert der zugrundeliegenden beziehungnehmenden Aktien * Delta
2. B.2.Credit Linked Notes:Marktwert der zugrundeliegenden Basiswerte
3. B.3.Teilweise eingezahlte WertpapiereAnzahl der Aktien oder Anleihen * Marktwert der zugrundeliegenden Vermögensgegenstände

Exotische Derivate

1. C.1.Variance Swaps:Variance Notional * (current) VarianceNotional * min [(current) Variance; volatility cap]bei

$$\text{Variance Notional} = \frac{\text{Vega Notional}}{2 \times \text{Strike}}$$

1. C.2.Volatility Swaps:Vega Notional * VolatilityVega Notional * min [(current) Volatility oder volatility cap]
1. C.3.Barrier Option:Anzahl der Verträge * fiktive Kontraktgröße (notional contract size) * Marktwert der zugrundeliegenden Aktie * max Delta

In Kraft seit 01.09.2011 bis 31.12.9999

© 2026 JUSLINE

JUSLINE® ist eine Marke der ADVOKAT Unternehmensberatung Greiter & Greiter GmbH.

www.jusline.at