



**SVET  
EVROPSKE UNIJE**

**Bruselj, 20. marec 2014  
(OR. en)**

---

**Medinstitucionalna zadeva:  
2011/0202(COD)**

---

**7863/14  
ADD 2**

**EF 85  
ECOFIN 271  
DELECT 75**

**SPREMNI DOPIS**

---

Pošiljatelj:	za generalnega sekretarja Evropske komisije: direktor Jordi AYET PUIGARNAU
Datum prejema:	12. marec 2014
Prejemnik:	generalni sekretar Sveta Evropske unije Uwe CORSEPIUS
Št. dok. Kom.:	Priolga2 k C(2014) 1556 final
Zadeva:	PRILOGA k DELEGIRANI UREDBI KOMISIJE o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi za ne-delta tveganja, povezana z opcijami, pri standardiziranem pristopu za tržna tveganja

---

Delegacije prejmejo priloženi dokument Priolga2 k C(2014) 1556 final.

---

Priloga: Priolga2 k C(2014) 1556 final



EVROPSKA  
KOMISIJA

Bruselj, 12.3.2014  
C(2014) 1556 final

ANNEX 2

## **PRILOGA**

**k**

### **DELEGIRANI UREDBI KOMISIJE**

**o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi za ne-delta tveganja, povezana z opcijami, pri standardiziranem pristopu za tržna tveganja**

## PRILOGA

k

### DELEGIRANI UREDBI KOMISIJE

**o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi za ne-delta tveganja, povezana z opcijami, pri standardiziranem pristopu za tržna tveganja**

#### Priloga II

#### Formula, ki se uporabi za namene člena 9(d)

Formula, ki se uporabi za namene člena 9(d)

$$\text{Kapitalska zahteva} = -\min(0, SC - DU)$$

pri čemer velja:

- (a) SC („sprememba cene“) je vsota sprememb cene opcij z istim posebnim osnovnim instrumentom v smislu člena 5(3) (negativni predznak za izgube, pozitivni predznak za dobičke), ki ustreza relevantnemu scenariju, določenemu v koraku (c) člena 8(2);
- (b) DU je „delta učinek“, izračunan na naslednji način:

$$DU = AVDE \times OSCO$$

pri čemer velja:

- (i) AVDE („agregirana vrednost delta ekvivalenta“) je vsota negativnih ali pozitivnih delt, pomnožena s tržno vrednostjo osnovnega instrumenta v pogodbi, opcij, ki imajo isto posebno vrsto osnovnega instrumenta v smislu člena 5(3);
- (ii) OSCO („odstotna sprememba cene osnovnega instrumenta“) je odstotna sprememba cene osnovnega instrumenta v smislu člena 5(3), ki ustreza relevantnemu scenariju, določenemu v koraku (c) člena 8(2).