

Futures Options Delta Handout

FUTURE	DELTA UNDERLYING	DELTA ATM OPTIONS
/ES	50	25
/MES	5	2.5
/NQ	20	10
/MNQ	2	1
/YM	5	2.5
/MYM	0.5	DNE
/RTY	50	25
/M2K	5	DNE
/ZB	1000	500
/ZN	1000	500
/ZF	1000	500
/ZT	2000	1000
/GE	2500	1250
/GC	100	50
/MGC	10	DNE
/SI	5000	2500
/SIL	1000	DNE

FUTURE	DELTA UNDERLYING	DELTA ATM OPTIONS
/ZC	50	25
/XC	10	DNE
/ZW	50	25
/XW	10	DNE
/ZS	50	25
/XK	10	DNE
/6E	125000	62500
/M6E	12500	DNE
/6B	62500	31250
/M6B	6250	DNE
/6J	12500000	6250000
/MJY	1250000	DNE
/6C	100000	50000
/M6C	10000	DNE
/6A	100000	50000
/M6A	10000	DNE
/CL	1000	500
/QM	500	DNE
/NG	10000	5000
/QG	2500	DNE