

日経平均V I 先物取引における最終清算数値の算出方法の見直しについて

2022 年 12 月 16 日
株式会社大阪取引所

I. 趣旨

日経平均ボラティリティー・インデックス先物取引（以下「日経平均V I 先物取引」といいます。）の最終清算数値は、日経平均先物取引及び日経平均オプション取引の日中立会開始以降の 10 分以内における各銘柄の始値を用いて当社が日経平均ボラティリティー・インデックス（以下「日経平均V I」といいます。）の算出方法に準じて算出した特別な数値としておりますが、現在の日経平均オプション取引の取引状況を勘案し、日経平均V I との連動が明確で一層安定性の高い最終清算数値とするべく算出方法の見直しを行うこととします。

II. 概要

| 項 目 | 内 容 | 備 考 |
|-----------------|---|--|
| 最終清算数値の算出方法の見直し | <ul style="list-style-type: none">取引最終日が終了する日の翌日（休業日に当たるときは、順次繰り下げます。）の午前9時以降の30分間における日経平均V I の平均値を日経平均V I 先物取引の最終清算数値とします。 | <ul style="list-style-type: none">日経平均V I は午前9時15秒から15秒間隔で算出されます。日経平均先物取引又は日経平均オプション取引の取引停止やサーキット・ブレーカー（SCB）に伴う取引中断等によって日経平均V I の更新が停止された場合、当該停止された時間は左記の30分間に含まないものとします。 |

III. 実施時期（予定）

2023年3月1日から実施します（日経平均V I 先物取引2023年3月限に係る最終清算数値から適用）。

以 上