

2016年3月16日

株式会社日本証券クリアリング機構

日経平均ボラティリティー・インデックスグループに係る
プライス・スキャンレンジの設定方法について

平素は当社清算・決済業務の運営に格別の御高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

日経平均ボラティリティー・インデックス（日経平均V I）グループのプライス・スキャンレンジ（P S R）の設定方法について、当社が定める「S P A Nパラメーターの取扱い」に基づき¹、下記のとおりとしますので御通知いたします。

記

1. P S Rの設定方法

基準日における日経平均V Iグループの原資産の終値の30%（0.05の整数倍に切り上げる）に10,000円を乗じて得た額とします。²

2. 適用開始日

2016年3月25日を基準日として算出するS P A Nパラメーターから適用します。

以上

《本件に関するお問合せ先》

株式会社日本証券クリアリング機構 取引所取引清算グループ

T e l : 03-3665-1381

E - m a i l : dailybiz@jscc.co.jp

¹ 本年3月25日から見直す「S P A Nパラメーターの取扱い」（「S P A Nパラメーターの設定方法等の見直しについて」（本年2月10日付ニュース）参照。))において、P S Rの水準が原資産の変動に対してあきらかに低い場合などには、原資産の終値に当社が定める率を乗じる方法でP S Rを算出することとしており、日経平均V Iグループはこれに該当します。

² 現行は、基準日における日経平均V Iの終値の25%（0.05の整数倍に切り上げる）に10,000円を乗じて得た額としています。また、日経平均V Iグループのその他のS P A Nパラメーターの設定方法については、S P A Nパラメーターの取扱いに定めるとおりとします。