

PRESS RELEASE



株式会社日本取引所グループ
〒103-8224 東京都中央区日本橋兜町2番1号
Tel : 03-3666-1361 (代表)

JAPAN EXCHANGE GROUP, INC.
2-1, Nihombashi-Kabuto-cho, Chuo-ku,
Tokyo 103-8224, Japan
Tel : +81-3-3666-1361

日本取引所グループ プレスリリース

URL: <http://www.jpx.co.jp/>

2015年9月18日

各位

株式会社日本取引所グループ
株式会社大阪取引所

“JPX 国債先物指数シリーズ”の算出及び公表について

株式会社日本取引所グループ（以下、JPX）及び株式会社大阪取引所（以下、OSE）は、次期デリバティブ売買システム（次期 J-GATE）稼働時から、以下のとおり、“JPX 国債先物指数シリーズ”¹の算出及び公表を開始します。当指数シリーズは、OSE で取引されている Large 長期国債先物取引の前日比価格変動率に対して一定の倍数を乗じた変動率となるように運用した場合のリターンを数値化した指数で、「JPX 国債先物指数」「JPX 国債先物インバース指数」「JPX 国債先物レバレッジ指数」及び「JPX 国債先物ダブルインバース指数」の4つから構成されます。

当指数シリーズは、2008年12月末の数値を10,000として指数化し、1日1回、終値を公表します。起点時の数値を統一することで各指数の値動きが比較可能となり、国債投資に当たっての新たな参考指標として御利用いただくことなどが期待されます。

指数の概要

指数名称	JPX 国債先物指数シリーズ
	JPX 国債先物指数
	JPX 国債先物インバース指数
	JPX 国債先物レバレッジ指数
	JPX 国債先物ダブルインバース指数
指数計算方法	原則、期近限月の先物値段（取引最終日の1営業日前から次限月に交替）を用いて算出します。
算出頻度及び指数値の公表	次期 J-GATE を通じ、日次（終値ベース）で配信します。
算出及び公表開始日	次期 J-GATE 稼働時（2016年央を予定）

※ 当指数シリーズの算出要領等の詳細については、JPX ウェブサイト (<http://www.jpx.co.jp/news/2040/20150918-1.html>) に掲載しております。

以上

<本件に関するお問合せ先>

株式会社 日本取引所グループ

広報・IR部（大阪） 電話：06-4706-0802

¹ 当指数シリーズは、JPX 及び OSE の知的財産であり、当指数シリーズの算出、数値の公表及び利用など当指数に関する権利を JPX 及び OSE が所有しております。当指数シリーズの算出方法や取扱いについて変更がある場合は、別途公表いたします。