

日経平均ボラティリティ・インデックス先物取引における最終清算数値の 算出に係る取扱いに関する業務規程施行規則の一部改正について

2022年11月24日
株式会社大阪取引所

I. 趣旨

当社は、業務規程施行規則の一部改正を行い、2022年12月1日から施行します（詳細については、規則改正新旧対照表を御覧ください。）。

今回の改正は、日経平均ボラティリティ・インデックス先物取引（以下「日経平均V I先物」といいます。）2022年10月限において、最終清算数値（以下「SQ値」といいます。）の算出に用いる日経平均オプション2022年11月限（プットオプション）で始値を採用できる権利行使価格がなかったことにより、原指数から乖離したSQ値¹が算出されたことを踏まえ、こうした例外的な事例に備えたSQ値算出の取扱いを定めるものです。

II. 改正概要

- 日経平均を対象とする指数プットオプション又は指数コールオプション（アット・ザ・マネーを除きます。）のいずれかにおいて、始値を取得することができる銘柄（日経平均ボラティリティ・インデックス（以下「日経平均V I」といいます。）の算出に用いる銘柄に限ります。）が存在しない限月については、直前の日経平均V Iの算出に用いた日経平均株価の変動率（ボラティリティ）を用いることとします。

（備考）

- 業務規程施行規則第22条第3項

III. 施行日

- 2022年12月1日から施行します。

以上

¹ 同日の日経平均V Iの始値が26.23ptのところ、SQ値は12.40pt。