

# 日経平均ボラティリティー・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ー・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<sup>1</sup>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ー・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（ボラティリティー）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

---

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