

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伴う
業務規程等の一部改正新旧対照表

目次

(ページ)

業務規程の一部改正新旧対照表・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 1

業務規程施行規則の一部改正新旧対照表・・・・・・・・・・・・・・・・ 2

業務規程の一部改正新旧対照表

新	旧
(最終清算数値) 第36条 最終清算数値は、取引最終日の終了する日の翌日に定めるものとし、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号に定めるところにより算出した特別な指数又は数値（以下「特別清算数値」という。）とする。ただし、フレックス限月取引において、各銘柄の設定時にあらかじめ最終清算数値を特別清算数値としないことを定めるものは、取引最終日における取引対象指数の最終の数値とする。 (1) ～ (5) (略) (6) 日経平均V I 取引最終日の属する月の翌月の第二金曜日の30日前に当たる日の本所が定める時間における<u>日経平均V Iの平均値</u> (7) ～ (9) (略) 2 前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号のいずれかに該当した場合で本所が必要と認めるときにおける最終清算数値は、本所がその都度定める日に、本所がその都度定める。 (1) ～ (4) (略) (5) 日経平均V I 取引最終日の終了する日の翌日に、<u>前項第6号に定める本所が定める時間を確保できない場合その他これに類する場合又は指数算出者による日経平均V Iの算出若しくは配信が不能となった場合</u> (6) ・ (7) (略) 3・4 (略) 付 則 この改正規定は、令和5年3月1日から施行する。	(最終清算数値) 第36条 最終清算数値は、取引最終日の終了する日の翌日に定めるものとし、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号に定めるところにより算出した特別な指数又は数値（以下「特別清算数値」という。）とする。ただし、フレックス限月取引において、各銘柄の設定時にあらかじめ最終清算数値を特別清算数値としないことを定めるものは、取引最終日における取引対象指数の最終の数値とする。 (1) ～ (5) (略) (6) 日経平均V I 取引最終日の属する月の翌月の第二金曜日の30日前に当たる日の本所が定める時間における<u>日経平均を対象とする指数先物取引及び日経平均に係る指数オプション取引の立会の始めの約定値段を用いて日経平均V Iの算出方法に準じて算出した特別な数値</u> (7) ～ (9) (略) 2 前項の規定にかかわらず、次の各号に掲げる取引対象指数の区分に従い、当該各号のいずれかに該当した場合で本所が必要と認めるときにおける最終清算数値は、本所がその都度定める日に、本所がその都度定める。 (1) ～ (4) (略) (5) 日経平均V I 取引最終日の終了する日の翌日に、<u>第32条の規定により日経平均を対象とする指数先物取引又は日経平均に係る指数オプション取引が停止された場合</u> (6) ・ (7) (略) 3・4 (略)

業務規程施行規則の一部改正新旧対照表

新	旧
(特別清算数値算出に係る値段) 第 2 2 条 (略) 2 規程第 3 6 条第 1 項第 6 号に規定する本所が定める時間は、<u>午前 9 時から 3 0 分間</u> (日経平均 V I の算出に用いる日経平均を対象とする指数先物取引又は日経平均に係る指数オプション取引の限月取引について、<u>規程第 3 2 条の規定により取引の停止が行われた時間及び規程第 3 3 条第 1 項、第 4 項又は第 5 項の規定により取引の一時中断が行われた時間を除く。</u>) とする。 (削る) 付 則 この改正規定は、令和 5 年 3 月 1 日から施行する。	(特別清算数値算出に係る値段) 第 2 2 条 (略) 2 規程第 3 6 条第 1 項第 6 号に規定する本所が定める時間は、<u>日経平均に係る指数オプション取引の日中立会開始時から 1 0 分間</u> (同号に掲げる特別な数値の算出に用いる日経平均を対象とする指数先物取引の限月取引について、<u>規程第 3 3 条第 1 項の規定により取引の一時中断が行われた時間を除く。</u>) とする。 3 <u>規程第 3 6 条第 1 項第 6 号の規定により、日経平均 V I の算出方法に準じて特別清算数値を算出する場合、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 (特別清算数値の算出に用いる日経平均を対象とする指数先物取引における有効な価格 (規程第 3 6 条第 1 項第 6 号に規定する立会の始めの約定値段をいう。以下この項において同じ。) に最も近接する権利行使価格の銘柄を除く。) のいずれかにおいて、有効な価格を取得することができる銘柄 (日経平均 V I の算出に用いる銘柄に限る。) 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を用いることとする。</u>