

《 発表資料 》

2011年9月27日  
日本経済新聞社

「日経平均ボラティリティー・インデックス」のリアルタイム算出について

日本経済新聞社は、来年1月から「日経平均ボラティリティー・インデックス（日経平均V I）」をリアルタイムで算出、公表します。

日経平均V Iは、将来の相場変動を予測するための指数として、大阪証券取引所の日経平均オプション取引価格を使って、昨年11月から終値ベースで算出してきました。

欧州不安などを背景に、日中の値動きに対する投資家の関心が高まっていることから、来年1月下旬を目途に、同オプションの日中取引時間帯を対象に15秒間隔でのリアルタイム算出に移行することにしました。

以上