

本日（3月4日）の日経平均V I の値について

本日、大阪証券取引所の先物・オプション売買システムに障害が発生し、当該障害の間、大証は先物及びオプション取引を「売買停止」としました。

日経平均ボラティリティー・インデックス（日経平均V I）は日経平均オプション及び日経平均先物の取引価格情報を用いて15秒おきに算出していますが、売買停止中の10時45分00秒から14時10分00秒までの間の指数値としては、「19.67」（以下、“当該値”）を、大証のJ-GATE経由で配信しました。

これは、システム上、オプション取引の売買停止指示がコール（買う権利）、プット（売る権利）の順に多少の時間差をもって実施されたため、コールが売買停止となってからプットが売買停止となるまでにプットの価格情報のみを使って算出したためであり、それ以降、売買停止が解除されるまでの間、“当該値”を指数の直近値として引き継いだことによるものです。

参考までに、“当該値”を除いた3月4日の日経平均V I の四本値は以下のとおりとなります。（安値と安値時刻が異なります。）

始値	28.19
高値（9:00:45）	28.25
安値（14:10:15）	27.00
終値	27.14