

日経平均ボラティリティー・インデックスの算出要領の改定について

日本経済新聞社は、日経平均ボラティリティー・インデックス（VI）の算出要領を改定します。指数算出の際、これまでユーロ円 LIBOR を用いていましたが、東京ターム物リスク・フリー・レート（TORF）を用いるように計算方法を変更します。2021年12月13日の算出から適用します。計算方法の変更の詳細については、改定後の算出要領（2021年12月13日版）をご参照ください。

なお、LIBOR に替えて TORF を適用した場合の日々の終値の試算値は以下の通りです。

日付	試算値（TORF 適用）	日経平均 VI 終値 （LIBOR 適用）
2021/11/1	20.26	20.26
2021/11/2	20.10	20.10
2021/11/4	19.55	19.55
2021/11/5	19.79	19.79
2021/11/8	19.71	19.71
2021/11/9	20.18	20.18
2021/11/10	20.87	20.87
2021/11/11	20.38	20.38
2021/11/12	19.35	19.35

※試算値と実際の指数値に差分はありません。