Settlement Rates (Interest Rate Swaps)

2026/11/9

JPY OIS		
1D	1.22900	%
1W	1.22750	%
2W	1.22729	%
3W	1.22750	%
1M	1.22750	%
2M	1.29260	%
3M	1.34247	%
4M	1.37007	%
5M	1.40617	%
6M	1.43798	%
7M	1.46758	%
8M	1.49580	%
9M	1.52109	%
10M	1.54453	%
11M	1.56450	%
1Y	1.58376	%
15M	1.63625	%
18M	1.67688	%
2Y	1.74875	%
3Y	1.86875	%
4Y	1.97625	%
5Y	2.07833	%
6Y	2.17661	%
7Y	2.27708	%
8Y	2.37813	%
9Y	2.47658	%
10Y	2.56867	%
11Y	2.65500	%
12Y	2.73523	%
15Y	2.94032	%
20Y	3.18587	%
25Y	3.31875	%
30Y	3.37886	%
35Y	3.39146	%
40Y	3.38625	%

JPY 3M Japanese Yen TIBOR (3M DTIBOR)		
3M(0X3)	1.78652	%
4M(1X4)	1.96938	%
5M(2X5)	2.00125	%
6M(3X6)	2.03625	%
7M(4X7)	2.08438	%
8M(5X8)	2.13938	%
9M(6X9)	2.18250	%
10M(7X10)	2.20155	%
11M(8X11)	2.21750	%
1Y	47.12500	bp
18M	46.25000	bp
2Y	47.00000	bp
3Y	47.62500	bp
4Y	49.00000	bp
5Y	50.00000	bp
6Y	51.12500	bp
7Y	52.25000	bp
8Y	53.25000	bp
9Y	54.25000	bp
10Y	55.25000	bp
12Y	57.00000	bp
15Y	57.87500	bp
20Y	59.37500	bp
25Y	60.12500	bp
30Y	60.12500	bp

JPY 6M Japanese Yen TIBOR (6M DTIBOR)		
6M(0X6)	1.92608	%
7M(1X7)	2.05310	%
8M(2X8)	2.10563	%
9M(3X9)	2.15063	%
10M(4X10)	2.17813	%
11M(5X11)	2.20563	%
1Y	2.50000	bp
18M	1.87500	bp
2Y	1.87500	bp
3Y	1.37500	bp
4Y	0.00000	bp
5Y	-0.12500	bp
6Y	-0.12500	bp
7Y	0.12500	bp
8Y	0.37500	bp
9Y	0.87500	bp
10Y	1.12500	bp
12Y	1.87500	bp
15Y	3.12500	bp
20Y	5.12500	bp
25Y	5.25000	bp
30Y	5.25000	bp

JPY 1M Japanese Yen TIBOR (1M DTIBOR)		
1M	1.42000	%
3M	1.48750	%
6M	1.58750	%
9M	1.68875	%
1Y	27.37500	bp
18M	26.12500	bp
2Y	24.37500	bp
3Y	22.37500	bp
4Y	21.87500	bp
5Y	21.37500	bp
6Y	21.37500	bp
7Y	21.75000	bp
8Y	22.37500	bp
9Y	23.00000	bp
10Y	23.62500	bp
12Y	24.62500	bp
15Y	22.62500	bp
20Y	22.87500	bp
25Y	23.62500	bp
30Y	23.62500	bp

【清算値段の定義/Definition of Settlement rates】
・OIS：OISアウトライトのレートを%単位で表示。
・3M DTIBOR：3M～11MまではSPS（Single Period Swap）レートを%単位で表示、1Y以降はOISとのベーススプレッド（3M DTIBOR vs OIS+ベーススプレッド）をbp単位で表示。
・6M DTIBOR：6M～11MまではSPS（Single Period Swap）レートを%単位で表示、1Y以降は3M DTIBORとのベーススプレッド（6M DTIBOR vs 3M DTIBOR+ベーススプレッド）をbp単位で表示。
・1M DTIBOR：1M～9MまではDTIBORアウトライトのレートを%単位で表示、1Y以降は3M DTIBORとのベーススプレッド（1M DTIBOR+ベーススプレッド vs 3M DTIBOR）をbp単位で表示。

・OIS: The OIS outright rate in percentage.
・3M DTIBOR: From 3M to 11M, the SPS (Single Period Swap) rate in percentage and from 1Y and onwards, the basis spread with OIS (3M DTIBOR vs OIS + basis spread) in basis points (bp).
・6M DTIBOR: From 6M to 11M, the SPS (Single Period Swap) rate in percentage and from 1Y and onwards, the basis spread against 3M DTIBOR (6M DTIBOR vs 3M DTIBOR + basis spread) in basis points (bp).
・1M DTIBOR: From 1M to 9M, DTIBOR outright rate in percentage and from 1Y and onwards, the basis spread with 3M DTIBOR (1M DTIBOR + basis spread vs 3M DTIBOR) in basis points (bp).
・This is the reference translation of the original Japanese document. Japan Securities Clearing Corporation shall accept no responsibility or liability for damage or loss caused by any error, inaccuracy, or misunderstanding with regard to this translation.

【注意事項/Disclaimer】
・日本証券クリアリング機構（以下「JSCC」といいます）によって公表される清算値段データに関連するすべての権利は、JSCCに帰属します。
・JSCCによって公表される清算値段データの外部への再配信は厳禁です。
・本清算値段データは、各IRSクリアリング参加者の日々のポジションに関連する時価評価や当初証拠金などを算出するために、JSCCによって計算されています。
・本清算値段データは、公表日15:02時点の市場価格を使用して計算された平均値です。市場が不安定な状況など、JSCCがリスク管理上必要と判断した場合、JSCCは関連する平均値を修正することがあります。
・上記に限らず、JSCCは清算値段の計算方法を変更したり、計算を停止したり、使用を中止したりすることがあります。
・本清算値段データの正確性については、万全を期していますが、当社は当該情報の利用者に対し、一切の責任を負いません。

・Any and all rights related to the rates published by Japan Securities Clearing Corporation (hereinafter referred to “JSCC”) shall be vested in JSCC.
・External redistribution of the rates published by JSCC is strictly prohibited.
・The rates published by JSCC are calculated by JSCC for the purpose of calculating the current market values as well as Initial Margin, etc. pertaining to each IRS Clearing Participant’s day-to-day positions.
・The rates published by JSCC are the average values calculated using the current market prices as of 15:02 on the publication date. When JSCC deems necessary for its risk management, such as in the volatile market condition, JSCC may revise the relevant average value.
・Not limited to the foregoing, JSCC may change the calculation method of, suspend calculation of, or cease any use of, the rates published by JSCC.
・JSCC seeks to ensure the accuracy of the rates. However, JSCC shall accept no liability for inaccuracies in the data in this report.

【Contact】
Japan Securities Clearing Corporation OTC Derivatives Clearing Service
Tel : +81-50-3361-1794
e-mail ： otc@jpx.co.jp