金利スワップ取引に係る当初証拠金の試算値
Result of Trial Calculation of Initial Margin for IRS

・金利スワップ取引における標準的な取引（OISと固定金利を交換する取引）のうち、主要な年限の取引に係る当初証拠金の水準及び当初証拠金の割合（対想定元本比）は下表のとおりです。なお、想定元本は10億円です。

・For standard IRS transactions (OIS vs. Fixed Rate), the table below shows the Initial Margin levels and Initial Margin ratios (vs. Notional Amount) for transactions at major tenors. Note that the notional amount is JPY1 billion.

As of	2024/3/29
Notional Amount (JPY)	1,000,000,000

Tenor	Fixed Rate (%)	Receive Fix (vsOIS)		Pay Fix (vsOIS)	
		Initial Margin (JPY thousand)	IM Ratio vs Notional Amount	Initial Margin (JPY thousand)	IM Ratio vs Notional Amount
1Y	0.17566	1,137	0.11%	1,010	0.10%
2Y	0.28899	3,165	0.32%	2,705	0.27%
5Y	0.49125	10,679	1.07%	8,927	0.89%
7Y	0.63375	15,416	1.54%	15,075	1.51%
10Y	0.84031	22,820	2.28%	24,228	2.42%
20Y	1.34406	43,574	4.36%	48,000	4.80%
30Y	1.50813	60,946	6.09%	71,946	7.19%
40Y	1.52563	76,571	7.66%	98,938	9.89%

【注意事項 / Note】

・上記データは試算値です。当該データの正確性については、万全を期しておりますが、当社は当該データの利用者に対し、一切の責任を負いません。
・当社は、上記データの出所を明示する場合にのみ当該データの転用・引用を認めます。商用目的で転載等を行う場合、あらかじめ当社までご連絡ください。

・The above data results from trial calculations. JSCC seeks to ensure the accuracy of the data. However, JSCC provides no guarantee that the data is error-free. Therefore JSCC shall assume no responsibility for the use or interpretation of this data.
・The above data can be re-used or quoted as long as the data source is indicated. Please contact JSCC in advance for any reprinting, etc. for commercial purposes.

【お問合せ先 / Contact】
（株）日本証券クリアリング機構　OTCデリバティブ清算部 / Japan Securities Clearing Corporation, OTC Derivatives Clearing Service
電話 / Tel：+81-50-3361-1794
E-mail：otc@jpx.co.jp