

## Settlement Rates (Interest Rate Swaps)

2026/1/29

JPY OIS			JPY 3M Japanese Yen TIBOR (3M DTIBOR)			JPY 6M Japanese Yen TIBOR (6M DTIBOR)			JPY 1M Japanese Yen TIBOR (1M DTIBOR)		
1D	0.72700	%	3M(0X3)	1.11630	%	6M(0X6)	1.25108	%	1M	0.85625	%
1W	0.72750	%	4M(1X4)	1.18000	%	7M(1X7)	1.30375	%	3M	0.92000	%
2W	0.72757	%	5M(2X5)	1.24563	%	8M(2X8)	1.35685	%	6M	1.02625	%
3W	0.72750	%	6M(3X6)	1.31030	%	9M(3X9)	1.43750	%	9M	1.10875	%
1M	0.72750	%	7M(4X7)	1.37470	%	10M(4X10)	1.49065	%	1Y	20.37500	bp
2M	0.73630	%	8M(5X8)	1.44250	%	11M(5X11)	1.54250	%	18M	19.50000	bp
3M	0.76247	%	9M(6X9)	1.51095	%	1Y	0.25000	bp	2Y	17.75000	bp
4M	0.79240	%	10M(7X10)	1.57625	%	18M	-0.75000	bp	3Y	15.87500	bp
5M	0.82117	%	11M(8X11)	1.63878	%	2Y	-1.37500	bp	4Y	13.25000	bp
6M	0.84843	%	1Y	40.25000	bp	3Y	-2.37500	bp	5Y	11.25000	bp
7M	0.87517	%	18M	41.62500	bp	4Y	-3.00000	bp	6Y	9.75000	bp
8M	0.89919	%	2Y	42.75000	bp	5Y	-3.37500	bp	7Y	8.87500	bp
9M	0.92324	%	3Y	45.00000	bp	6Y	-3.37500	bp	8Y	8.87500	bp
10M	0.94895	%	4Y	46.75000	bp	7Y	-3.37500	bp	9Y	9.37500	bp
11M	0.97565	%	5Y	48.62500	bp	8Y	-3.25000	bp	10Y	9.50000	bp
1Y	1.00125	%	6Y	50.00000	bp	9Y	-3.12500	bp	12Y	10.50000	bp
15M	1.06688	%	7Y	51.37500	bp	10Y	-3.00000	bp	15Y	11.25000	bp
18M	1.13000	%	8Y	52.62500	bp	12Y	-2.87500	bp	20Y	12.12500	bp
2Y	1.24625	%	9Y	53.87500	bp	15Y	-2.12500	bp	25Y	12.37500	bp
3Y	1.40500	%	10Y	55.00000	bp	20Y	-0.75000	bp	30Y	12.62500	bp
4Y	1.51833	%	12Y	56.12500	bp	25Y	-0.75000	bp			
5Y	1.60958	%	15Y	56.25000	bp	30Y	-0.75000	bp			
6Y	1.69292	%	20Y	56.62500	bp						
7Y	1.77667	%	25Y	56.87500	bp						
8Y	1.85792	%	30Y	56.87500	bp						
9Y	1.94000	%									
10Y	2.02414	%									
11Y	2.10438	%									
12Y	2.18375	%									
15Y	2.40400	%									
20Y	2.70291	%									
25Y	2.88542	%									
30Y	2.98416	%									
35Y	3.04525	%									
40Y	3.08469	%									

### 【清算値段の定義】/Definition of Settlement rates

- ・OIS : OISアーライトのレートを%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アーライトのレートを%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、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できます。
- ・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できます。
- ・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 as "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