d　この面において「下方パラレルシフト」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、ｃの表に定める「パラレルシフトに関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）」にマイナス１を乗じて得た数値を加える金利ショックをいう。

e　この面において「スティープ化」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、次の算式を用いて得た金利変動幅（以下この面において「スティープ化に関する金利変動幅」という。）を加える金利ショックをいう。

$$\Delta R_{steepener,c}(t) = -0.65 \cdot \left(\bar{R}_{short,c} \cdot e^{\frac{-t}{x}}\right) + 0.9 \cdot \left\{\bar{R}_{long,c} \cdot \left(1 - e^{\frac{-t}{x}}\right)\right\}$$

$\Delta R_{steepener,c}(t)$は、スティープ化に関する金利変動幅

cは、通貨（以下この面において同じ。）

tは、将来の期間を年数で表した値（以下この面において同じ。）

$\bar{R}_{short,c}$は、通貨に応じて、次の表に定める「短期金利に関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）」（以下この面において同じ。）

$\bar{R}_{long,c}$は、通貨に応じて、次の表に定める「長期金利に関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）」（以下この面において同じ。）

xは、４（以下この面において同じ。）

通貨	短期金利に関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）	長期金利に関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）
アルゼンチン通貨	500	300
オーストラリア通貨	450	200
ブラジル通貨	500	300
カナダ通貨	300	150
スイス通貨	150	100
中華人民共和国通貨	300	150
欧州経済通貨統合参加国通貨	250	100
英国通貨	300	150
中華人民共和国（香港特別行政区）通貨	250	100
インドネシア通貨	500	300
インド通貨	500	300
本邦通貨	100	100
大韓民国通貨	400	200
メキシコ通貨	500	300
ロシア通貨	500	300
サウジアラビア通貨	300	150
スウェーデン通貨	300	150
シンガポール通貨	200	100
トルコ通貨	500	300
アメリカ合衆国通貨	300	150
南アフリカ共和国通貨	500	300
その他の通貨	100から500のうち、自金融機関が定める値	100から300のうち、自金融機関が定める値

f　この面において「フラット化」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、次の算式を用いて得た金利変動幅（以下この面において「フラット化に関する金利変動幅」という。）を加える金利ショックをいう。

$$\Delta R_{flattener,c}(t) = 0.8 \cdot \left(\bar{R}_{short,c} \cdot e^{\frac{-t}{x}}\right) - 0.6 \cdot \left\{\bar{R}_{long,c} \cdot \left(1 - e^{\frac{-t}{x}}\right)\right\}$$

$\Delta R_{flattener,c}(t)$は、フラット化に関する金利変動幅

g　この面において「短期金利上昇」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、次の算式を用いて得た金利変動幅（以下この面において「短期金利上昇に関する金利変動幅」という。）を加える金利ショックをいう。

$$\Delta R_{short,c}(t) = \bar{R}_{short,c} \cdot e^{\frac{-t}{x}}$$

$\Delta R_{short,c}(t)$は、短期金利上昇に関する金利変動幅

h　この面において「短期金利低下」とは、通貨及び将来の期間ごとに、当該通貨及び当該将来の期間に応じた算出基準日時点のリスクフリー・レートに、短期金利上昇に関する金利変動幅にマイナス１を乗じて得た数値を加える金利ショックをいう。

i　項番１「上方パラレルシフト」の項には、上方パラレルシフトに基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）及びΔＮＩＩ（ハ欄及びニ欄）を記載すること。

j　項番２「下方パラレルシフト」の項には、下方パラレルシフトに基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）及びΔＮＩＩ（ハ欄及びニ欄）を記載すること。

k　項番３「スティープ化」の項には、スティープ化に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

l　項番４「フラット化」の項には、フラット化に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

m　項番５「短期金利上昇」の項には、短期金利上昇に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

n　項番６「短期金利低下」の項には、短期金利低下に基づくΔＥＶＥ（イ欄及びロ欄）を記載すること。

o　項番７「最大値」の項イ欄及びロ欄には、それぞれの欄の項番１から項番６までの値のうち最大のものを記載すること。

p　項番７「最大値」の項ハ欄及びニ欄には、それぞれの欄の項番１又は項番２の値のうちいずれか大きいものを記載すること。