b　この面において「ΔＮＩＩ」とは、金利リスクのうち、金利ショックに対する算出基準日から12ヶ月を経過する日までの間の金利収益の減少額として計測されるものをいう。

c　この面において「上方パラレルシフト」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、次の表に定める「パラレルシフトに関する金利変動幅（ベーシス・ポイント）」を加える金利ショックをいう。

通貨	パラレルシフト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	400
オーストラリア通貨	300
ブラジル通貨	400
カナダ通貨	200
スイス通貨	100
中華人民共和国通貨	250
欧州経済通貨統合参加国通貨	200
英国通貨	250
中華人民共和国（香港特別行政区）通貨	200
インドネシア通貨	400
インド通貨	400
本邦通貨	100
大韓民国通貨	300
メキシコ通貨	400
ロシア通貨	400
サウジアラビア通貨	200
スウェーデン通貨	200
シンガポール通貨	150
トルコ通貨	400
アメリカ合衆国通貨	200
南アフリカ共和国通貨	400
その他の通貨	100から400のうち、自金融機関が定める値

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