なお、シナリオ作成に使用するNelson-Siegelモデル及びVARモデルについて以下のパターンを仮定する。

* Nelson-Siegelモデル

規模パラメータについて以下2つのパターンでシナリオを作成

パターン1：で固定

パターン2：を変数とする（グリッドサーチにより決定）

* 金利VARモデル
  + 金利VARモデルの構造

パターン1：の組み合わせで推定

パターン2：の組み合わせで推定

* + パラメータ推定期間

パターン1：1995年3月～2020年9月

パターン2：2002年3月～2020年9月

* + 外生変数の設定

日米ともに期待インフレ率のみ除く