(12) 特許協力条約に基づいて公開された国際出願

(19) 世界知的所有権機関
国際事務局

(43) 国際公開日
2012 年 10 月 4 日(04.10.2012)

WIPO | PCT

(10) 国際公開番号
WO 2012/132352 A1

(51) 国際特許分類:
G06Q 10/06 (2012.01)

(21) 国際出願番号: PCT/JP2012/002003

(22) 国際出願日: 2012 年 3 月 23 日(23.03.2012)

(25) 国際出願の言語: 日本語

(26) 国際公開の言語: 日本語

(30) 優先権データ:
特願 2011-072743 2011 年 3 月 29 日(29.03.2011) JP

(71) 出願人 (米国を除く全ての指定国について): 日本電気株式会社(NEC Corporation) [JP/JP]; 〒1088001 東京都港区芝五丁目７番１号 Tokyo (JP).

(72) 発明者; および
(75) 発明者/出願人 (米国についてのみ): 森永 聡(MORINAGA, Satoshi) [JP/JP]; 〒1088001 東京都港区芝五丁目７番１号 日本電気株式会社内 Tokyo (JP). 今村 悟(IMAMURA, Satoru) [JP/JP]; 〒1058574 東京都港区芝三丁目３３番１号 三井住友トラスト・ホールディングス株式会社内 Tokyo (JP).

(74) 代理人: 馬場 資博, 外(BABA, Motohiro et al.); 〒3500046 埼玉県川越市菅原町２５番地１ 石井ビル２階 Saitama (JP).

(81) 指定国 (表示のない限り、全ての種類の国内保護が可能): AE, AG, AL, AM, AO, AT, AU, AZ, BA, BB, BG, BH, BR, BW, BY, BZ, CA, CH, CL, CN, CO, CR, CU, CZ, DE, DK, DM, DO, DZ, EC, EE, EG, ES, FI, GB, GD, GE, GH, GM, GT, HN, HR, HU, ID, IL, IN, IS, KE, KG, KM, KN, KP, KR, KZ, LA, LC, LK, LR, LS, LT, LU, LY, MA, MD, ME, MG, MK, MN, MW, MX, MY, MZ, NA, NG, NI, NO, NZ, OM, PE, PG, PH, PL, PT, QA, RO, RS, RU, RW, SC, SD, SE, SG, SK, SL, SM, ST, SV, SY, TH, TJ, TM, TN, TR, TT, TZ, UA, UG, US, UZ, VC, VN, ZA, ZM, ZW.

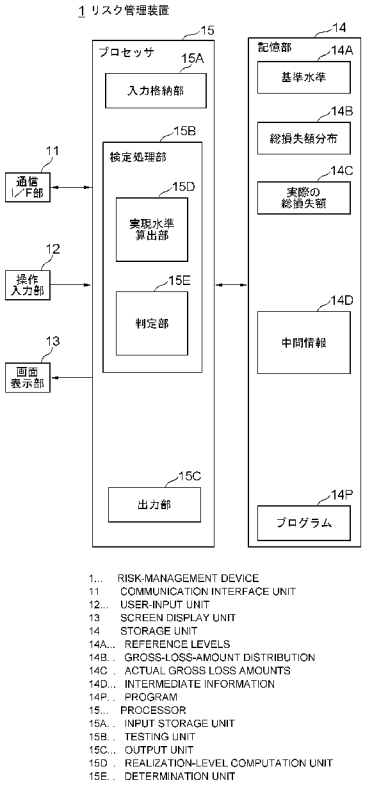
(84) 指定国 (表示のない限り、全ての種類の広域保護が可能): ARIPO (BW, GH, GM, KE, LR, LS, MW, MZ, NA, RW, SD, SL, SZ, TZ, UG, ZM, ZW), ユーラシア (AM, AZ, BY, KG, KZ, MD, RU, TJ, TM), ヨー

[続葉有]

(54) **Title**: RISK-MANAGEMENT DEVICE

(54) 発明の名称 : リスク管理装置

[図1]



1... RISK-MANAGEMENT DEVICE
11 ... COMMUNICATION INTERFACE UNIT
12... USER-INPUT UNIT
13 ... SCREEN DISPLAY UNIT
14 ... STORAGE UNIT
14A... REFERENCE LEVELS
14B... GROSS-LOSS-AMOUNT DISTRIBUTION
14C ... ACTUAL GROSS LOSS AMOUNTS
14D... INTERMEDIATE INFORMATION
14P... PROGRAM
15... PROCESSOR
15A... INPUT STORAGE UNIT
15B... TESTING UNIT
15C... OUTPUT UNIT
15D ... REALIZATION-LEVEL COMPUTATION UNIT
15E... DETERMINATION UNIT

(57) Abstract: The following are provided: a memory that stores actual gross loss amounts for N periods; and a processor connected to said memory. The processor is programmed to determine whether or not realization levels follow a uniform distribution over the interval [0, 1], said realization levels indicating confidence intervals for actual gross loss amounts in a gross-loss-amount distribution computed by a risk-measurement device, by testing goodness of fit using order statistics of the aforementioned uniform distribution.

(57) 要約: Ｎ期分の実際の総損失額を記憶するメモリと、このメモリに接続されたプロセッサとを備える。プロセッサは、リスク計量装置が算出した総損失額分布における実際の総損失額の信頼区間を示す実現水準が、区間［０，１］上の一様分布に従うか否かを、一様分布に対する順序統計量を用いた適合度の検定を用いて決定するようにプログラムされている。

WO 2012/132352 A1

ロッパ (AL, AT, BE, BG, CH, CY, CZ, DE, DK, EE, ES, FI, FR, GB, GR, HR, HU, IE, IS, IT, LT, LU, LV, MC, MK, MT, NL, NO, PL, PT, RO, RS, SE, SI, SK, SM, TR), OAPI (BF, BJ, CF, CG, CI, CM, GA, GN, GQ, GW, ML, MR, NE, SN, TD, TG).

添付公開書類:

— 国際調査報告（条約第 21 条(3)）