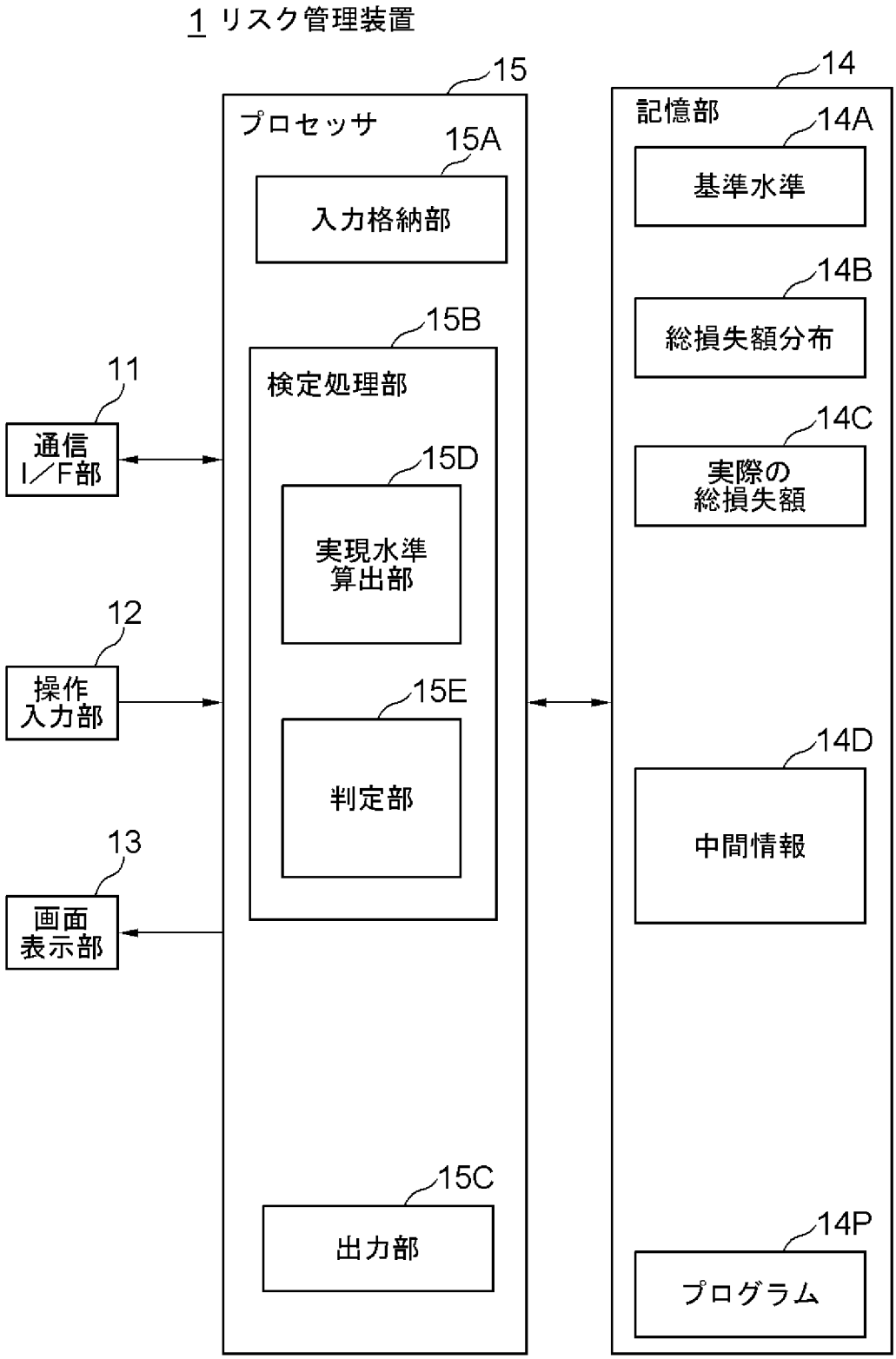
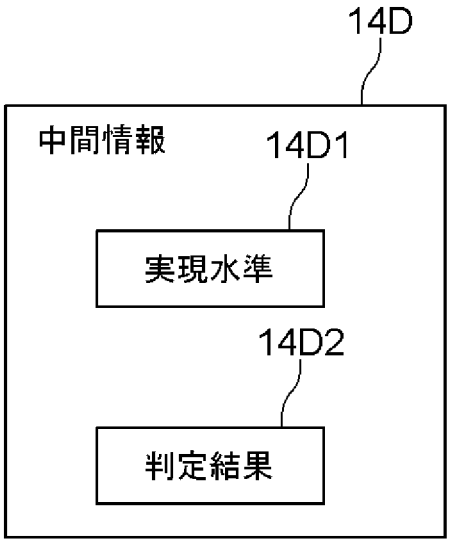
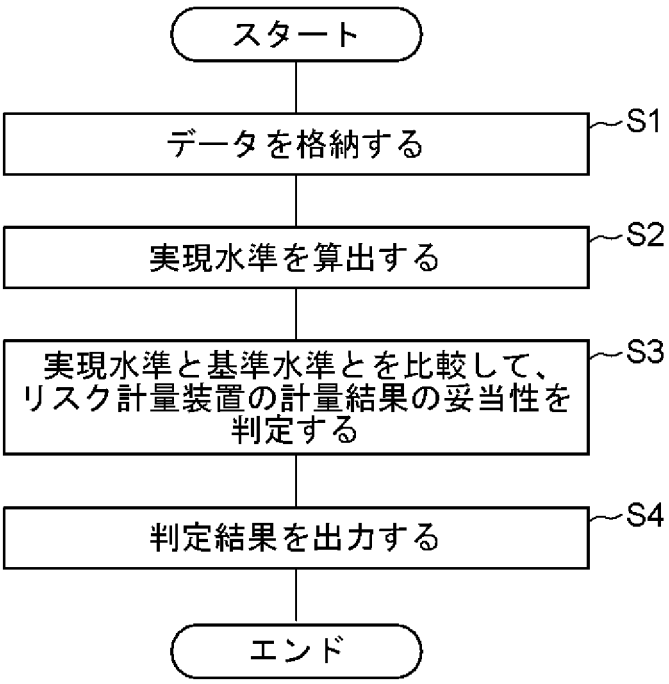
[図1]


1 リスク管理装置
15
プロセッサ
15A
入力格納部
15B
検定処理部
15D
実現水準
算出部
15E
判定部
15C
出力部
14
記憶部
14A
基準水準
14B
総損失額分布
14C
実際の
総損失額
14D
中間情報
14P
プログラム
11
通信
I／F部
12
操作
入力部
13
画面
表示部

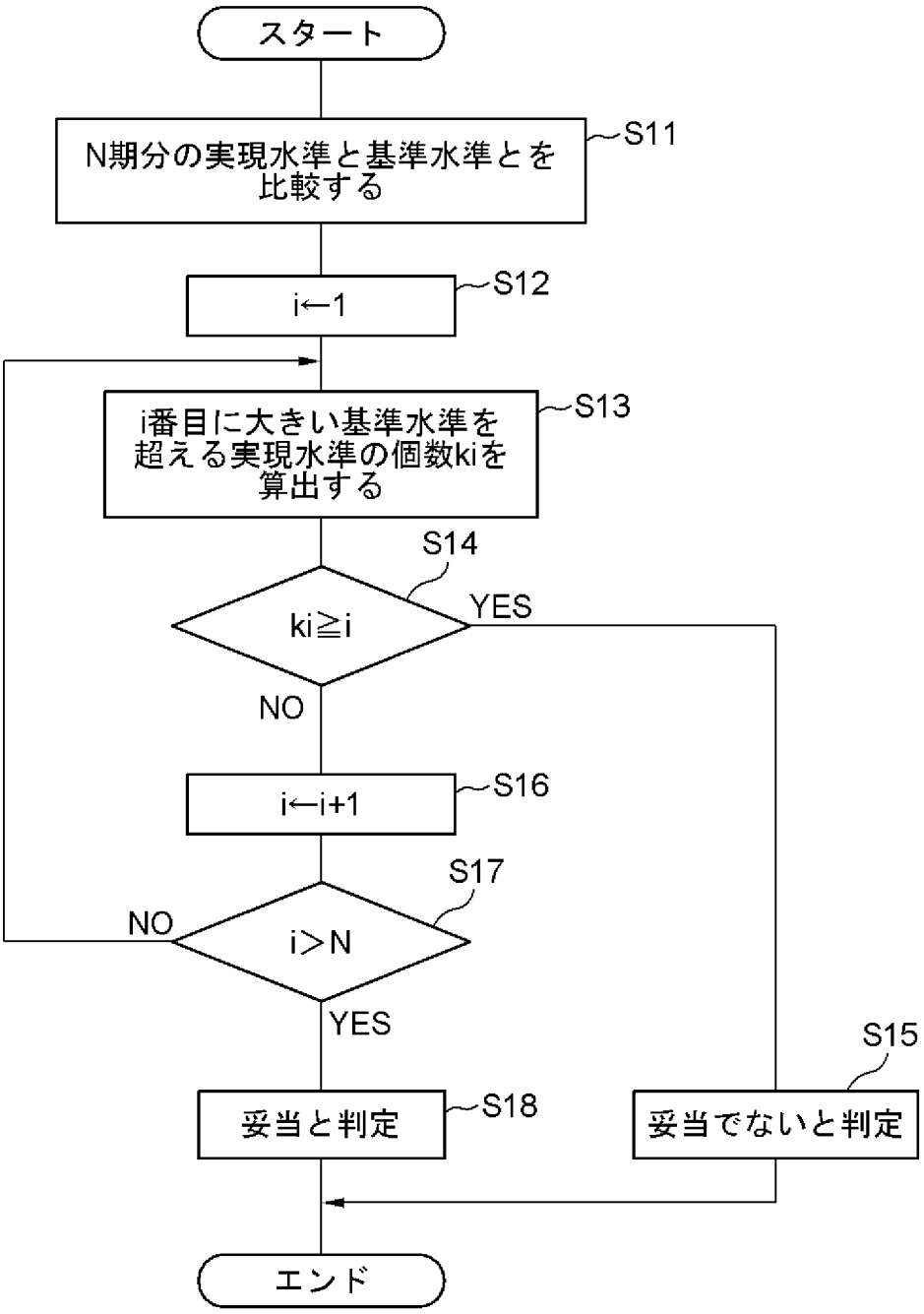
[図2]



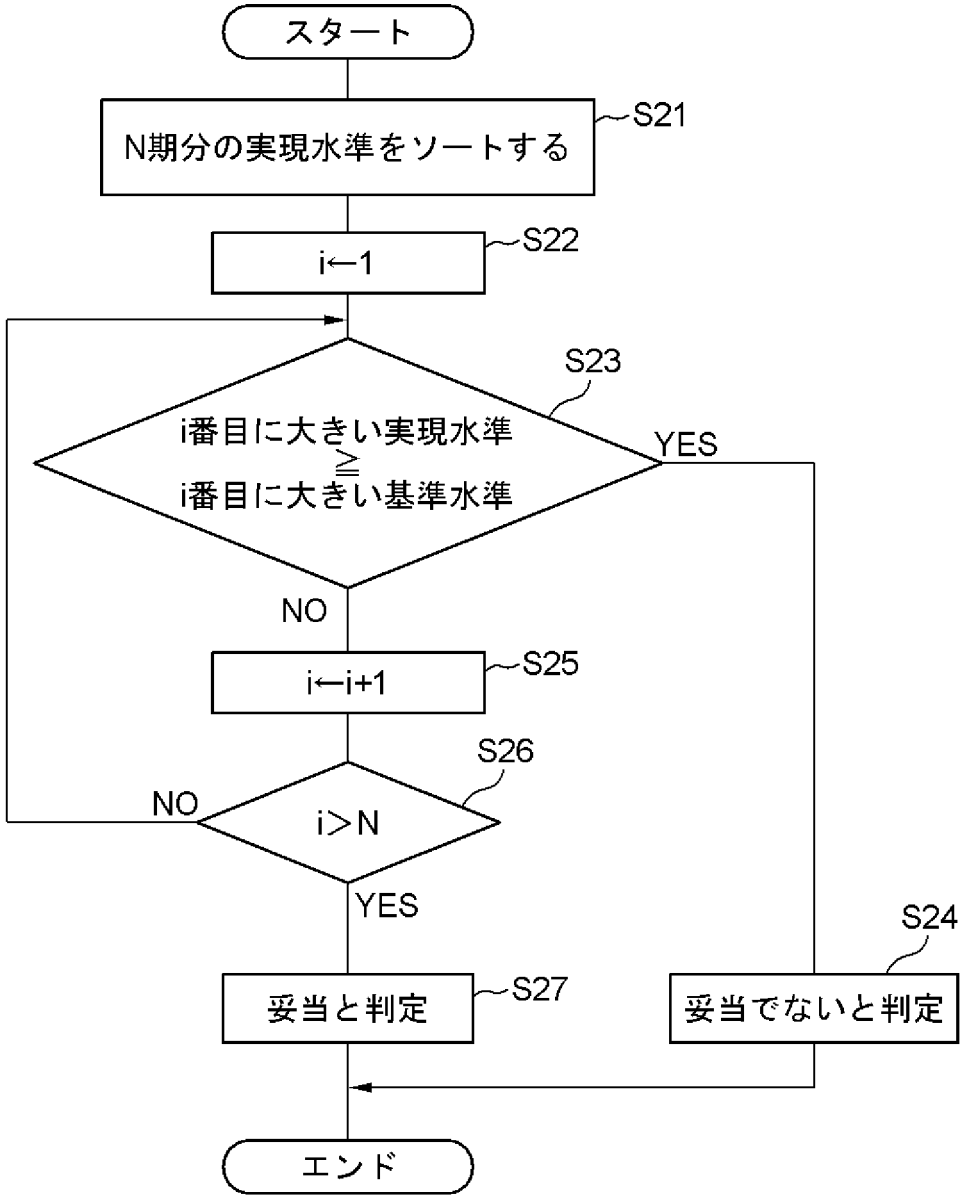
[図3]


スタート
データを格納する
S1
実現水準を算出する
S2
実現水準と基準水準とを比較して、リスク計量装置の計量結果の妥当性を判定する
S3
判定結果を出力する
S4
エンド

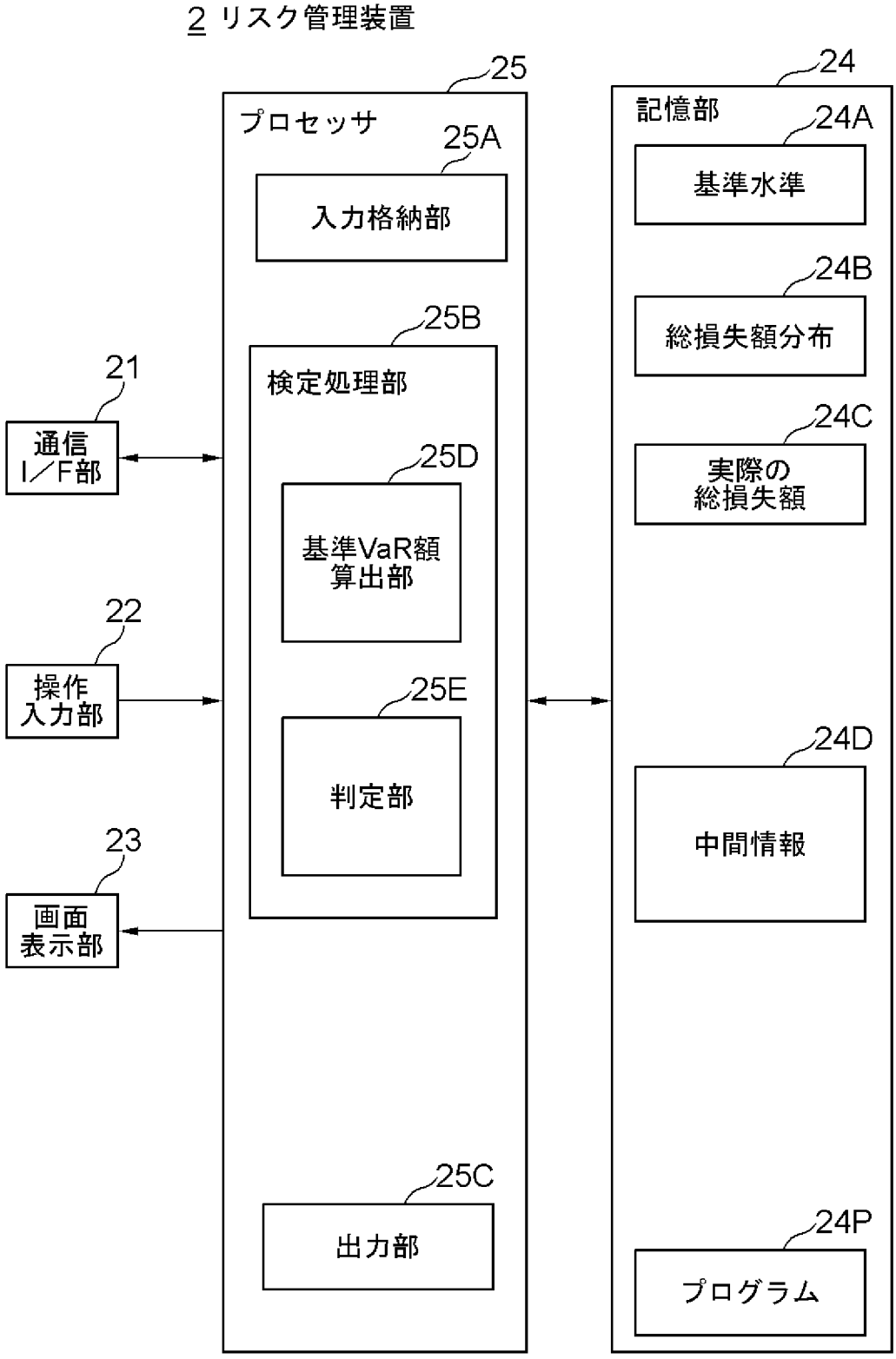
[図4]


スタート
N期分の実現水準と基準水準とを比較する
S11
i←1
S12
i番目に大きい基準水準を超える実現水準の個数kiを算出する
S13
S14
ki≧i
YES
NO
i←i+1
S16
S17
NO
i>N
YES
S15
妥当と判定
S18
妥当でないと判定
エンド

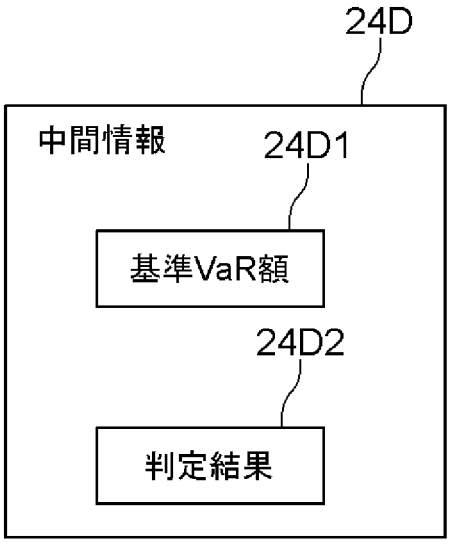
[図5]


スタート
N期分の実現水準をソートする
S21
i←1
S22
S23
i番目に大きい実現水準
≧
i番目に大きい基準水準
YES
NO
i←i+1
S25
S26
NO
i>N
YES
S24
妥当と判定
S27
妥当でないと判定
エンド

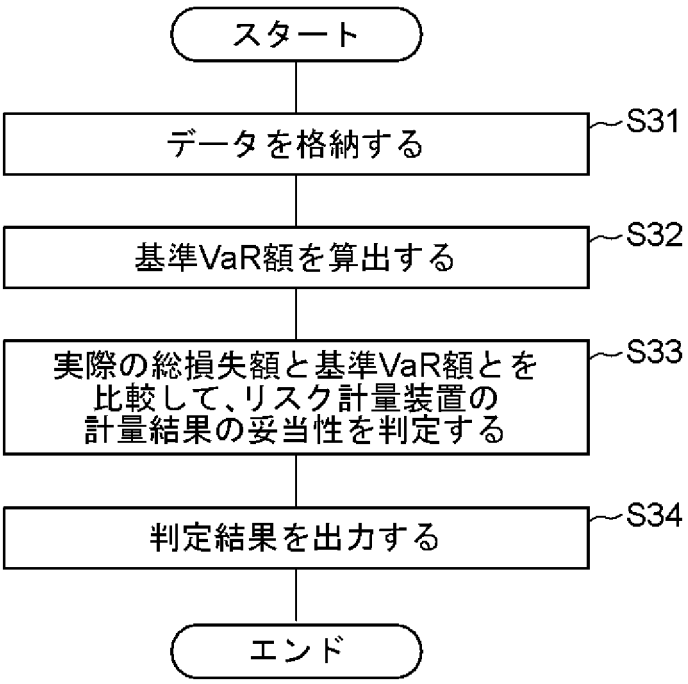
[図6]


2 リスク管理装置
25
プロセッサ
25A
入力格納部
25B
検定処理部
25D
基準VaR額
算出部
25E
判定部
25C
出力部
21
通信
I／F部
22
操作
入力部
23
画面
表示部
24
記憶部
24A
基準水準
24B
総損失額分布
24C
実際の
総損失額
24D
中間情報
24P
プログラム

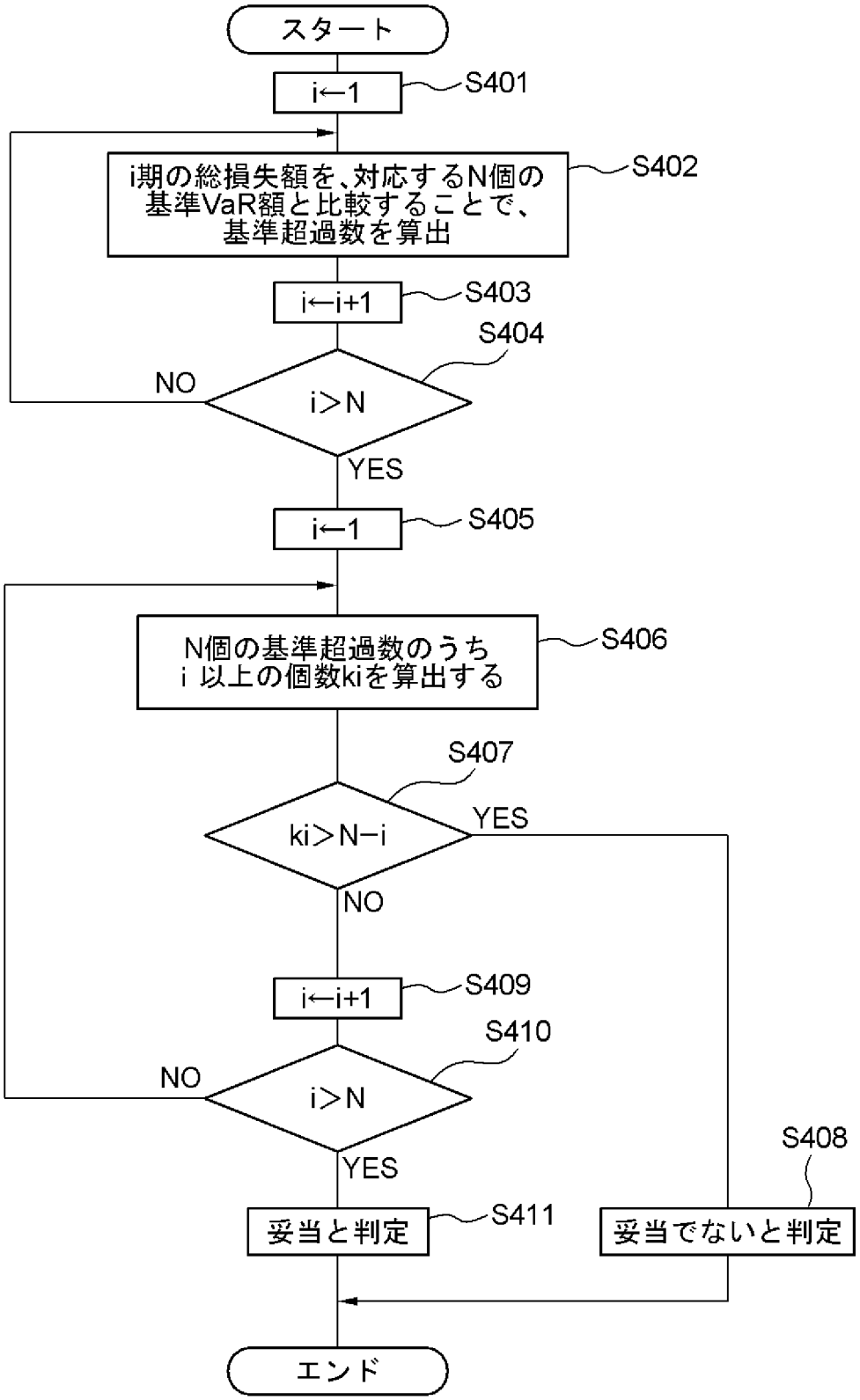
[図7]



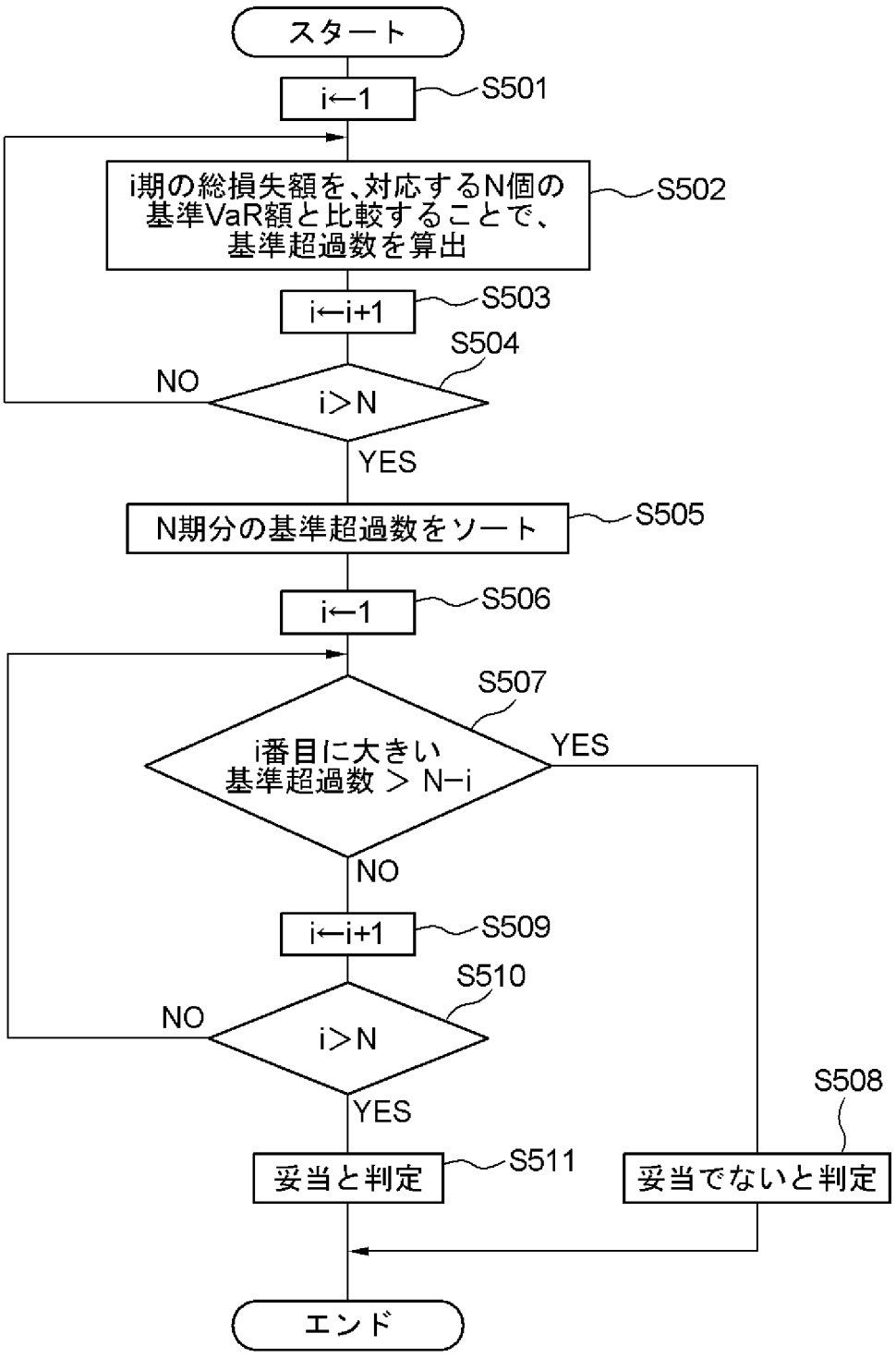
[図8]


スタート
データを格納する
S31
基準VaR額を算出する
S32
実際の総損失額と基準VaR額とを
比較して、リスク計量装置の
計量結果の妥当性を判定する
S33
判定結果を出力する
S34
エンド

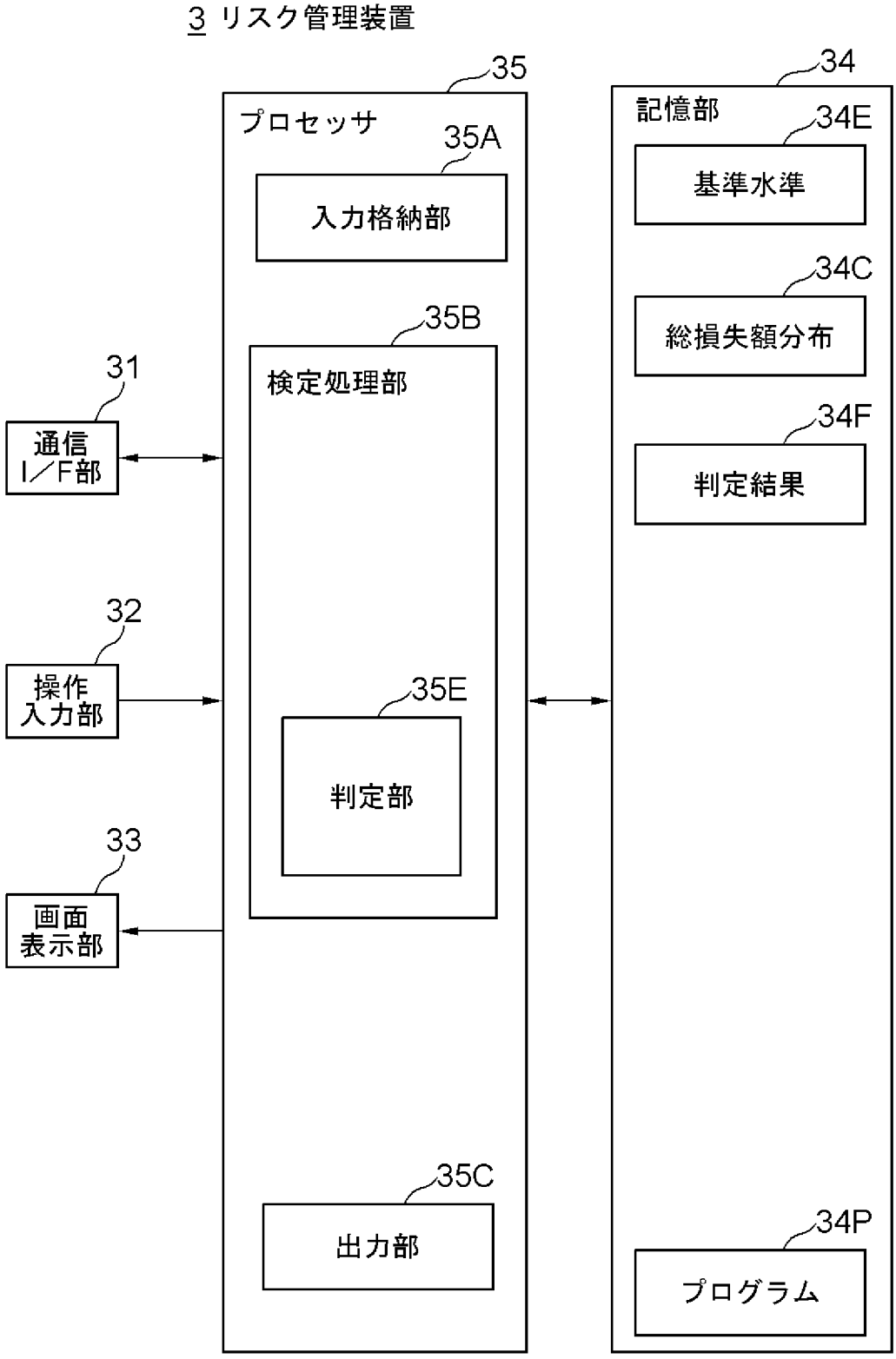
[図9]


スタート
i←1
S401
i期の総損失額を、対応するN個の基準VaR額と比較することで、基準超過数を算出
S402
i←i+1
S403
S404
NO
i>N
YES
i←1
S405
N個の基準超過数のうちi 以上の個数kiを算出する
S406
S407
ki>N−i
YES
NO
i←i+1
S409
S410
NO
i>N
YES
S408
妥当と判定
S411
妥当でないと判定
エンド

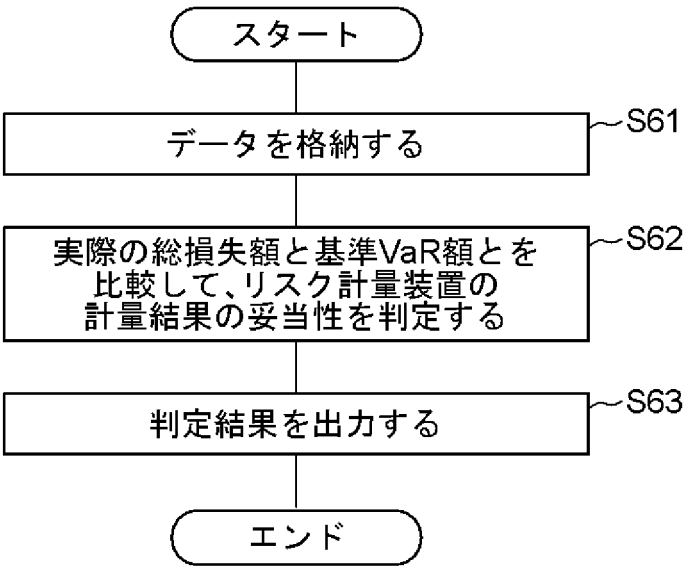
[図10]


スタート
i←1
S501
i期の総損失額を、対応するN個の基準VaR額と比較することで、基準超過数を算出
S502
i←i+1
S503
S504
NO
i>N
YES
N期分の基準超過数をソート
S505
i←1
S506
S507
i番目に大きい基準超過数 > N−i
YES
NO
i←i+1
S509
S510
NO
i>N
YES
S508
妥当と判定
S511
妥当でないと判定
エンド

[図11]


3 リスク管理装置
35
プロセッサ
35A
入力格納部
35B
検定処理部
35E
判定部
35C
出力部
34
記憶部
34E
基準水準
34C
総損失額分布
34F
判定結果
34P
プログラム
31
通信
I／F部
32
操作
入力部
33
画面
表示部

[図12]


スタート
データを格納する
S61
実際の総損失額と基準VaR額とを
比較して、リスク計量装置の
計量結果の妥当性を判定する
S62
判定結果を出力する
S63
エンド

[図13]

n	$F^{-1}_{U(n;5)}(0.95)$	$F^{-1}_{U(n;5)}(0.99)$
1	0.451	0.602
2	0.657	0.778
3	0.811	0.894
4	0.924	0.967
5	0.990	0.998