

# Risk Simulator 2011

Arcsine, Бернуллиевые, Бета, Бета 3, Бета 4, Бином, Коши, Хи-квадрат, Косинус, Индивидуализированные распределения, Дискретная Униформа, Логарифм, Показательная функция, Экспоненциальные второй степени, F Распределение, Гамма, Геометрическая, Гамбел Макс, Гипергеометрическая функция, теория Лапласа, Логистическая, Логарифмически нормальная (Арифметический) и Логарифмически нормальный (Логарифм), Lognormal3 (Арифметик) и Lognormal3 (Логарифм), Отрицательный Бином, Нормальный, Параболический, Парето, Паскаль, Пирсон V, Пирсон VI, Пирссон, Мощность, Мощность 3, Рэлея, T и T2, Треугольные и Равномерные распределения, Weibull, Weibull 3

100 000 испытаний за несколько секунд  
 Скорость моделирования высшего качества

Собственные распределения, управление историческими моделированиями, применяя метод Дельфи  
 Индивидуализированное Распределение

Коррелированные моделирование, усечения, чередующиеся параметры, многомерное моделирование  
 Дискретные и Непрерывные Распределения

Установите входные предположения и прогнозы результата, используя функции в Excel  
 Распределения как Функции Excel

Коррелированные моделирование со связями (Нормальный, T, Квазиермальный)  
 Корреляции

Латинский Гиперкуб, Монте-Карло  
 Выборка Методов

ROV Генератор, Случайный Генератор Перетасовки По Нисходящей, Генератор Перетасовки Длительного периода, Портативный Случайный Генератор Перетасовки Быстрый Генератор IEEE, Основной Минимальный Портативный Генератор  
 Генератор случайных чисел

Мультифазовая Оптимизация  
 Обшая линейная оптимизация  
 Линейная Оптимизация

Подробные результаты, включая матрицы Гессона, Функции Лагранжа и т.п.  
 Нелинейная Оптимизация

Быстрая оптимизация  
 Непрерывная, с целыми числами и двойная оптимизация  
 Статическая Оптимизация

Моделирование с оптимизацией  
 Динамическая Оптимизация

quadratic, tangential, central, forward, convergence  
 Стохастическая Оптимизация

Комбинации стохастической и эволюционной оптимизации на многомерных эффективных фронтах  
 Эффективная Фронтита

Дистрибутивный Процентный Анализ  
 Распределения вероятности

Статистический анализ - описательная статистика, дистрибутивная примера, гистограммы, диаграммы, нелинейная экстраполяция, испытание нормальности, стохастическая оценка параметров, прогноз числового ряда, проекции линии тенденции, и т.д.

ROV BIZSTATS - более чем 130 деловых статистических данных и аналитических моделей: Абсолютные значения, АНОВА: Рандомизированные Блоки Множественное Обращение, АНОВА: Единственный Коэффициент и Множественное Обращение, АНОВА: Two Way Analysis, ARIMA, Auto ARIMA, Autocorrelation & Partial Autocorrelation, (Подробная) Автоэконометрия, Автоэконометрия (Быстрая), Диаграмма Контроля: С, Диаграмма Контроля: NP, Диаграмма Контроля: P, Диаграмма Контроля: R, Диаграмма Контроля: U, Диаграмма Контроля: X, Диаграмма Контроля: XMR, Корреляция (Линейная, Нелинейная), Графическая Ковариация, Кубический Сплайн, Индивидуализированные Эконометрические модели, Описательная статистика Данных, Функция сезонности, Дистрибутивная Примера, Показательная функция - J Кривая, GARCH, Гетероскедастность, Анализ Задержки, Лидерства, Ограниченные Зависимые Переменные (Логит), Ограниченные Зависимые Переменные (Пробит), Ограниченные Зависимые Переменные (Тобит), Линейная интерполяция, Линейная Регрессия, LN, Логарифмические Функции, Логистическая Кривая, С, Цепь Маркова, Макс, Медиана, Минута, Способ, Нелинейная Регрессия, Непараметрическое: Согласие Петерсона, Непараметрическое: Критерий Согласия, Непараметрическое: Дисперсия Совокупности Хи-квадрата, Непараметрический: Тест Фридмана, Непараметрический: Крускал-Уоллис Тест, Непараметрическое: Испытание Lilliefors, Непараметрическое: Испытание Пробегов, Непараметрический: Тест Wilcoxon (Один VAR), Непараметрический: Тест Wilcoxon (Два VARs), Параметрическая: Одна Переменная (T), Параметрическая: Одна Переменная (Z), Параметрическая: Одна Переменная (Z) Соотношения, Параметрические: Два Переменные (D) Дисперсия, Параметрические: Два Переменные (P) - тест Зависимости переменных, Параметрические: Два Переменная (T) Независимая Равная Дисперсия, Параметрические: Два Переменная (T) Независимая Неравная Дисперсия, Параметрические: Два Переменные (Z) Независимые Средства, Параметрические: Два Переменные (Z) Независимые Соотношения, Анализ Мощности, Анализ Основного компонента, Возрастае Ранга, Спуск Ранга, Относительные Возрастае LN, Относительные Возрастае, Сезонность: Объединение в кластеры Сегментации, Полустандартное отклонение (Йеке), Полустандартное отклонение (Ввер), Стандартная двумерная область, Стандартный двумерный ограничитель, Стандартная двумерная Линия, Стандартная двумерная Точка, Стандартный двумерный Разброс, Стандартная трехмерная область, Стандартный трехмерный Ограничитель, Стандартная трехмерная Линия, Стандартная трехмерная Точка, Стандартный трехмерный Разброс, Стандартное отклонение (Совокупность), Стандартное отклонение (Выборка), Пошаговая Регрессия (Обратная), Пошаговая Регрессия (Корреляция), Пошаговая Регрессия (Передовая), Пошаговая Регрессия (Передовые обратные), Стохастические процессы (Экспоненциальное Броуновское движение), Стохастические процессы (Геометрическое Броуновское движение), Стохастические процессы (Диффузия Скачка), Стохастические процессы (Обращение с Диффузией Скачка), Стохастические процессы Структурный Разрыв, Анализ числового ряда: Двойное Экспоненциальное Сглаживание, Двойное Скользящее среднее значение, Сезонный Мультипликативный Анализ, Экспоненциальное Сглаживание, Единственное Скользящее среднее значение, Линия Тенденции: линейное удаление тренда, Экспоненциальное Удаление Тренда, Показательная функция, Логарифмическое Удаление Тренда, Удаление по Скользящей средней, Многочленная Функция Удаления тренда, Линия Тенденции (Многочлен), Линия Тенденции (Мощность), Линия Тенденции (Разрывное Удаление Тренда), Дисперсия (Совокупность), Дисперсия (Выборка), Изменчивость: EGARCH, Изменчивость: EGARCH-T, Изменчивость: GARCH, Изменчивость: GARCH-m, Изменчивость: GJR GARCH, Изменчивость: GJR TGARCH, Изменчивость: Подход Возвращений Логарифма, Изменчивость: TGARCH, Изменчивость: TGARCH-m, Кривая доходности и Кривая доходности (Nelson-Zigterl).

Английский, французский, немецкий, итальянский, японский, корейский, португальский, испанский, Упрощенный китайский

Работы в Window 7, Vista and XP; интегрируется с Excel 2010, 2007, 2003; и в MAC, управляющих виртуальными машинами

Полностью настраиваемые цвета и диаграммы (наклон, трехмерный, цвет, тип диаграммы, и многое другое)

Множественные языковые пользовательские справочники и справочные файлы

42 подробных модели в качестве примеров

Пригодный для редактирования к Реальным Опционам SLS и Modeling Toolkit

Все исследования идут с подробными отчетами

Функции PTC и щелчок правой кнопкой мыши поддерживаются в Excel

Отлично интегрирование с другим программными обеспечениям ROV включая: Real Options, SLS, Modeling Toolkit, Basel Toolkit, ROV Compiler, ROV Extractor and Evaluator, ROV Modeler, ROV Validator, ROV Optimizer, ROV Dashboard, ESO Valuation Toolkit, и многих других

6 генераторов случайных чисел, 3 связи корреляции (Нормальная, T, Квазиермальная), и 2 выборочных метода, а также Латинский Гиперкуб и Анализ Монте-Карло

42 Распределения

Индивидуализированное Распределение

Дискретные и Непрерывные Распределения

Распределения как Функции Excel

Корреляции

Выборка Методов

Генератор случайных чисел

Линейная Оптимизация

Нелинейная Оптимизация

Статическая Оптимизация

Динамическая Оптимизация

Стохастическая Оптимизация

Эффективная Фронтита

Дистрибутивный Процентный Анализ

Распределения вероятности

Деловая Статистика

ARIMA

Авто-ARIMA

Авто-Эконометрия

Базовая Эконометрия

Кубический Сплайн

GARCH

Кривые J-S

Цепи Маркова

Ограниченные Зависимые Переменные

Множественный Регрессионный Анализ

Нелинейная Экстраполяция

Стохастические процессы

Анализ числового ряда

Тренды

Общие Функции

Проверяет модель на наиболее распространенные ошибки

Эти функции проверяют условные вероятности, незначительность статистической ошибки, модульность данных, нелинейности, автокорреляция, нормальность, широкоразности, нестационарности, мультиколлинеарности и аномальные корреляции

Использует данные предыдущих моделей, файлы SML, статистические отчеты анализов и отчеты о результатах прогнозов

Восстанавливает результаты предыдущего моделирования

Функция вычисляет точный PDF, CDF и ICDF всех 42 распределений и производит таблицы вероятности

Создаёт собственные распределения данных

Модель Колмогорова-Смирнова и Дистрибутивный Анализ - проверяют данные на непрерывность распределений. Дополнены независимыми отчетами и дистрибутивными обобщениями

Управляет множественными переменными одновременно, составляет корреляции и измеряет отклоняемость корреляций

Анализ статистической подобности двух или более прогнозов

Моделирование статистических результатов, для измерения точности результатов

Полностью настраиваемые overlaid диаграммы одновременно предположений и прогнозов (CDF, PDF, двумерные/трехмерные типы диаграммы)

Находит наилучшие переменные предиктора и способы создания множества данных

Тысячи статистических двумерных сценариев

Испытания на различные отклонения сезонности

Функция объединения данных в статистические группы для того, чтобы сегментировать их

Динамическая чувствительность (одновременный анализ)

Описательная статистика, дистрибутивные наложения, гистограммы, диаграммы, нелинейная экстраполяция, испытание нормальности, стохастическая оценка параметров, прогноз временного ряда, проекции линии тенденции, и т.д.

Анализ данных натурального ряда на статистические структурные разрывы

Анализ статической чувствительности, Анализ чувствительности "торнадо" и "пузыря"

Авторегрессионные интегрированные модели скользящего среднего значения ARIMA (P, D, Q)

Управляет наиболее распространенными комбинациями ARIMA, чтобы найти модель оптимальной подгонки

Анализ тысяч комбинаций и перестановок, чтобы получить модель оптимальной подгонки для существующих данных (линейный, нелинейный, взаимодружающий, задерживающий, ведущий, сегментированный по разрывам, анализ различий)

эконометрические и линейные/нелинейные и взаимодействующие модели регрессии

Нелинейная интерполяция и экстраполяция

Проекция изменчивости, использующие обобщенные авторегрессионные условные гетероскедастные модели: GARCH, GARCH-m, TGARCH, TGARCH-m, EGARCH, EGARCH-T, GJR-GARCH, GJR-TGARCH

Логистическая S и показательная J кривые

Предсказание поведения двух конкурирующих элементов данных в течение долгого времени в рамках заданных переменных

Логит, Пробит, Тобит: логистические обоснованные регрессии для предсказания вероятности события

Линейная и нелинейная регрессия, пошаговая регрессия с подробными отчетами (переходя, задерживающаяся, комбинационная корреляция)

Нелинейный прогноз числового ряда

Предсказания с использованием моделирования, как геометрического так и экспоненциального, и Броуновского движения, ограниченного обращения, и диффузии скачка, и смешанных процессов

8 моделей разложения числового ряда для предсказаний уровней, тенденций и сезонностей

Линейные, нелинейные, мощности, логарифмические, экспоненциальные, Скользящее среднее значение с наложением