

# Risk Analysis 风险分析

## Training DVD 培训DVD

### 培训DVD包含：

#### 使用Risk Simulator进行Monte Carlo仿真

- 使用仿真统计结果
- 选择相应的分布
- 相关和截取分布
- 解释仿真结果
- 多维仿真

#### 使用Risk Simulator进行预测

- Box-Jenkins ARIMA建模
- 多元回归分析
- 随机过程预测
- 时间序列预测和非线性外推

#### Risk Simulator进行优化

- 连续性优化
- 决策分析
- 整型优化

#### 实物期权分析和SLS软件

- 实物期权分析基础
- 解释风险分析过程和波动性预测
- 使用SLS软件求解期权问题，包括放弃期权，美式期权，障碍期权
- 百慕大期权，选择期权，收缩期权，欧式期权，扩张期权，连续混合期权，转换期权，多资产多阶段复杂混合期权

#### 分析工具

- 分布拟合
- 假设检验
- 非参数拔靴法

 Real Options  
Valuation

 Valuation

## 培训DVD包含10张DVD碟片主要涵盖了一下内容:

使用Risk Simulator软件进行蒙特卡洛仿真  
使用Risk Simulator软件进行预测  
使用Risk Simulator软件进行优化  
通过Real Options Super Lattice 求解器软件进行实物期权分析工具

作为培训DVD的一部分,您可以获得10张DVD光盘,一本幻灯片式的教材,以及包含在DVD中的案例,以及以下两本由Johnathan Mun博士编写的专著:“Modeling Risk: Applying Monte Carlo Simulation, Real Options Analysis, Forecasting, and Optimization, 2nd Edition,” (Wiley Finance, 2006), 以及由Johnathan Mun博士编写的“Real Options Analysis: Tools and Techniques, 2nd Edition,” (Wiley Finance 2005), 以及培训中所要使用的模型CD。点击下载我们的培训DVD手册。

课程都是由Johnathan Mun博士开发,由他开发了Risk Simulator软件, Real OptionsSLS软件,他是金融学,经济学的教授,多本关于实物期权,风险分析专著的作者, Real Options Valuation公司的CEO。

在每套DVD中都涵盖了以下的内容。每盘DVD都分为不同的章节和模块,详细内容如下:

### DVD 1: 风险分析介绍

章节 1: 培训DVD介绍  
章节 2: 商业决策是如何制定的?  
章节 3: 什么是风险?为何要考虑风险?  
章节 4: 风险分析软件应用概述

### DVD 2: 应用Risk Simulator软件进行蒙特卡洛仿真

章节 1: Risk Simulator软件概述  
章节 2: 仿真文档,定义假设,预测和运行仿真  
章节 3: 解释预测的结果  
章节 4: 运行仿真的设置和随机数种子  
章节 5: 运行报告,保存输出的仿真数据

### DVD 3: 高级仿真技术

章节 1: 相关分布  
章节 2: 备选参数  
章节 3: 多维仿真  
章节 4: 数据拟合和概率分布选择  
章节 5: 仿真的缺陷和应注意事项

### DVD 4: 仿真和分析工具

章节1: 静态的飓风图和蛛网图  
章节 2: 静态的敏感性分析  
章节 3: 不同分布的假设检验  
章节 4: 非参数自助

### DVD 5: 预测

章节 1: 预测技术和数据类型概述  
章节 2: 无数据预测  
章节 3: 时间序列预测  
章节 4: 非线性外推法  
章节 5: 多元回归分析  
章节 6: 随机过程  
章节 7: Box-Jenkins ARIMA

### DVD 6 & 7: 实物期权分析: 理论和背景

章节 1: 介绍实物期权: 5W1H  
章节 2: 商业案例分析  
章节 3: 不同的期权分析技术概述: 金融期权和实物期权比较  
章节 4: 风险中性概率  
章节 5: 解决基本的欧式期权和美式期权  
章节 6: 使用微软Excel解决基本的欧式期权和美式期权问题  
章节 7: 解决基本的放弃期权, 扩展期权, 交易期权和选择期权问题

### DVD 8 & 9: 通过SLS 软件进行预测

章节 1: SLS软件不同模块介绍  
章节 2: 波动率预测估计  
章节 3: 改变输入参数和客户化奇异期权解决期权问题  
章节 4: 多重阶段混合期权  
章节 5: 使用三叉, 四叉和五叉栅格解决均值-回复, 跳跃-扩散, 二重资产彩虹期权问  
章节 6: 构建实物期权模型  
章节 7: 下一步骤...

### DVD 10: 使用Risk Simulator软件进行优化

章节 1: 优化介绍  
章节 2: 连续优化  
章节 3: 整数优化

## 专家

乔纳森·文博士 (Dr. Johnathan Mun) 是软件的开发,他同时教授风险分析 (Risk Analysis) 课程,针对分析员的实物期权分析 (Real Options for Analysts) 课程,针对管理者的实物期权分析 (Real Options for Managers) 课程,注册风险管理师 (CRM) 课程和别的课程。他为很多《财富》500强公司提供风险分析、价值评估和实物期权分析方面的咨询服务,并撰写了大量相关的书籍:包括《实物期权分析: 工具和方法》第一和第二版 (Wiley Finance, 2002, 2005); 《实物期权分析课程: 商业案例》 (Wiley Finance 2003); 《风险分析应用: 超越不确定性》 (Wiley Finance 2003); 《基于2004 FAS 123雇员股票期权定价》 (Wiley Finance 2004); 《风险建模: 应用蒙特卡罗模拟, 实物期权分析, 预测及最优化》 (Wiley 2006); 《高级分析模型: 从巴塞尔新资本协议到华尔街的800个函数和300个模型》 (Wiley 2008); 《银行家信用风险手册: 实施巴塞尔新资本协议》 (Elsevier Academic Press 2008), 以及其它的一些书籍 (以上著作 将继续推出中文版本)。他是Real Options Valuation, Inc公司的创始人和CEO,负责分析软件的开发,咨询和培训服务。他曾是 Decisioneering, Inc. (Oracle) 公司分析服务部门副总裁 和毕马威管理咨询公司 (KPMG) 全球金融战略部门的咨询经理。在加盟毕马威之前,他曾在联邦快递维京公司 (Viking, Inc) 担任金融计划和分析部门主管。文博士目前还是美国海军研究生院 (U.S. Naval Postgraduate School) 全职教授,以及法兰克福应用科学大学 (University of Applied Sciences, Frankfurt) 和瑞士管理学院 (Swiss School of Management, Zurich) 教授,同时还在世界各地的一些大学担任访问教授。他是金融学和经济学博士,工商管理硕士 (MBA), 管理科学硕士和应用科学学士。文博士持有注册金融风险管理师 (FRM) 认证、金融咨询师 (CFC) 认证,注册风险管理师 (CRM) 认证。

