

# 软件实际操作 研讨会和课程

**Certified in Risk Management (CRM)注册风险管理认证**  
**Senior Credit Risk Management (SCRM) 高级信用风险管理认证**

## 风险分析课程

- 分析工具
- 基本实物期权（SLS软件）
- 预测（Risk Simulator软件）
- Monte Carlo 仿真（Risk Simulator）
- 优化（Risk Simulator）

## 实物期权分析（分析师课程）

- 基本实物期权概念
- 了解实物期权的基础
- 构建基本的期权

## 实物期权分析（高管人员课程）

- 基本实物期权概念
- 使用实物期权制定战略决策
- 构建战略期权
- 解释实物期权的结果

## 员工股票期权

- 使用ESO软件二叉树模型评估员  
工股票期权满足FAS 123准则的要求

## 客户化课程

- 由公司指定的培训课程

参与我们培训课程的公  
司客户评价：

3M, Accenture, AIG,  
Allstate Insurance,  
Airbus, Alexion, Aquiva  
Trading, AT&T, Boeing,  
Chevron Texaco, Duke  
Energy, Eli Lilly, GE,  
GE Capital, Glaxo  
SmithKline, Intel,  
Johnson & Johnson,  
Lloyds Bank, Motorola,  
Phillips, Pioneer, Roche  
Molecular Diagnostics,  
Seagate, Schlumberger,  
Shell, Sprint, Sunoco,  
Syngenta, Timken, Total  
Elf Fina, Washington  
Gas, and many others!

**RO** Real Options  
Valuation

高级的分析工具例如Risk Simulator软件操作简便但是如果使用不当也会给分析人员带来麻烦。有效的理论支持加上实用的应用就变的十分重要。因此，培训是必要的。我们提供多个实际操作演练课程涵盖风险分析实物期权分析，等多个话题。保持较少的参与人数，保证更好的学习环境，和一对一的交流机会。课程在全球范围内开设（详细的时间安排请查看我们的最新培训安排），课程都安排在培训中心进行，客户可以使用自己的电脑作为软件终端。

我们两天的**风险分析**课程包括软件实际操作，内容包括基本的风险和不确定性概念，使用Monte Carlo仿真（缺点和注意事项），以及预测和优化的详细模型。两天的上机操作，使用Risk Simulator软件进行：

- Monte Carlo仿真（仿真，非参数拔靴仿真，相关性copula仿真，截取仿真，分布拟合，解释仿真结果，假设检验，数据输出，多维仿真，缺陷以及注意事项）
- 预测（时间序列预测，多远回归，非线性内插法，随机过程预测，Box-Jenkins ARIMA，基本计量经济学，GARCH模型，逻辑曲线，无数据预测，德尔菲法，季节模型，以及更多）
- 优化（线性连续离散整型变量优化，组合优化，有限前沿和决策分析技术）
- 建模分析（情景分析，敏感性分析，飓风图蜘蛛图，仿真，重叠图，以及更多）

基本的实物期权理论（商业案例，实物期权应用，实物期权基础）

对于分析人员我们通过引入实际案例操作，将实物期权分析和模拟直接引入工作之中。两天的课程包括如何设定实物期权模型，应用实物期权，以及使用仿真解决实物期权问题，闭合的数学模型，二叉，以及多叉树模型。

这个两天的实际操作课程包括

- 实物期权介绍：what, where, who, when, how, why
- 实物期权分析的相关案例
- 不同的期权评估技术：闭合模型，偏微分方程，二叉树
- 使用风险中性定价技术，欧式，美式期权以及百慕大期权，包括妨碍，扩张，收缩，选择，以及4种波动率估计模型和方法
- SLS软件的不同模块和计算波动率方法
- 改动参数和自定义奇异期权求解期权问题，复杂的多阶段混合期权，均值回复期权，跳跃扩散期权，双资产彩虹期权，三叉以及四叉期权
- 构建实物期权——构建问题模型

对于**高管人员**的一天风险分析课程专门为管理层所设计，所有的案例都来自于3M，空中客车，波音以及更多。为管理层提供了一个风险分析，实物期权，组合优化，预测和风险的视角，而并不包含过多的模型细节。这些课程的内容包括：

- 风险分析和期权分析的视角
- 部分真实世界中的跨国企业应用
- 战略期权的构建
- 构建战略期权的注意要点
- 理解如何解释实物期权的结果

注册风险管理认证（**CRM**）课程是一个4天的实战课程，包含的内容有风险分析和实物期权分析。该认证由国际职业教育和研究委员会提供。在完成了4天的培训和相关的项目活动就可以进入CRM认证流程。4-6周后，就可以得到CRM认证，以及相关的商业证明文件。

国际职业教育和研究委员会在全球多个国家和地区拥有办事处和合作伙伴，这些国家和地区包括：美国，瑞士，香港，墨西哥，葡萄牙，新加坡，尼日利亚，马来西亚等国家。国际职业教育和研究委员会的CRM认证是得到国家认证委员会认可的证书。国际职业教育和研究委员会是具有极高声望的商学院进步委员会的成员之一。商学院进步委员会是美国教育部最大的认证机构，它拥有500商学院的成员。而且，国际职业教育和研究委员会的国际准则委员会包括众多大学（宾州利哈伊大学，苏黎世应用科学大学，加利福尼亚美国海军研究生院，堪萨斯密苏里大学，等等）的教授。国际职业教育和研究委员会也和世界众多地区的研究机构保持良好 的战略合作伙伴关系。

### 完全自定义的企业内训

任何培训都可以由客户定制。包括由客户指定的培训内容，在行业中的商业案例，以及开放式提问，关于模型，数据或者战略

- 从行业的专家那里获得实战经验
- 直接获得有效的资源！我们的培训师就是Risk Simulator软件和Real Option SLS软件的发明人，7本风险建模，实物期权，和项目评估专著 的编写人。他本人也是金融学和经济学 的教授，曾经为多个国家的公司做过咨询和培训，世界公认 的风险分析和实物期权方面的专家。
- 得到我们免费的书籍，培训模型，案例，视频，课程的PPT 和很多的学习资料。

### 专家

乔纳森·文博士（Dr. Johnathan Mun）是软件的开发者，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）课程和其它的课程。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 将陆续推出中文版本）。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。