

CERTIFIED IN RISK MANAGEMENT

Certified
in Risk Management



“Dr. Johnathan Mun是一位充满激情的导师，最困难的项目到他手里都会变得通俗易懂。他真的是我遇见过最好的导师。”

-Curtis Ching, 通用, 通用金融(亚洲)商业发展和金融总监

“Dr. Mun可以让最复杂最专业的概念变得通俗易懂，并应用到不断变化充满挑战的商业环境中。这是我所参加过的最好的一次研讨会，我承认Dr. Mun是这个领域的领头人。”

-Robert Finocchiaro 博士, 3M公司(美国)公司研发服务部总监

参加一个为期四天的风险管理培训课程，完成相关的课程学习和获得由国际教育和研究机构(IIPER)颁发的注册风险管理师认证

“没有见过如此能干的培训师！” -Hussein Alghamdi, 沙特阿拉伯Savola集团 Group

“没有见过如此能干的培训师！” -Y.L.Lee, 希捷科技(Seagate Technology)工业工程师

“一次结合实例的非常好的培训” -Aprianto Sommantri, 印尼Chevron Texaco工程师

“Dr. Johnathan Mun将学习方法和教学材料有效结合起来，用一种可以理解的形式解释我们如何管理风险的认知图式的变化。鉴于未来商业的发展主要是基于警觉性决策的制定，Dr. Mun的方法是迄今为止支持公司可持续发展的最有效的机制。”

-Kenneth English, Timken公司(美国)新兴技术部总监

“Dr. Mun有能力将非常复杂的事情以事实和难忘的方式表达出来，参加他的研讨会，你不仅会收获很多，还可以立刻将所学运用到实践中。”

-Robert Fourt, Gerald Eve咨询公司(英国)合伙人

 Real Options
Valuation

Real Options Valuation, Inc. 公司是全球一家提供国际专业教育和研究的机构 (IIPER) 的首选课程提供商, 我们被授权开设CRM认证课程, 4天的研讨会, 以及课程最后一天的认证考试。参与者如果通过考试可以获得SCRM证书! Real Option Valuation公司是全球有权颁发CRM证书的三家机构之一。

那么, 与其他相比我们的研讨会由哪些优势呢? 令人吃惊的是, 我们的培训班价格比其他类似的模拟课程低很多, 在培训完之后, 你会获得CRM证书, 这是很多其他公司不能提供的。此外, 我们有指定的资深CRM培训师Dr. Johnathan Mun先生, Real Option Valuation公司的创始人及CEO, 一位世界知名的风险分析领域的专家教授, 在风险、估值和战略领域出版过7本书的作者, 以及风险模拟器和实物期权SLS软件的开发。相比之下, 其他公司的培训师都是两年以下工作经验的大学毕业生, 或是在风险分析理论和实践背景不足的普通MBA。你不仅可以学习到风险分析的实际应用, 还可以用理论来支撑这些应用。

优势

参与注册风险管理师 (CRM) 课程的几大优势:

- 获得注册风险管理师 (CRM) 认证
- 学习的对象是本领域最知名的专家。
- 利用源头! 课程是首席讲师是Risk Simulator和Real Options SLS软件的开发, 以及银行风险管理, 信用风险管理, 风险建模、实物期权分析和价值评估等专题12本书籍的作者。他们还是金融学和经济学学科的教授, 多家跨国公司的咨询顾问, 是风险分析和实物期权分析领域的全球知名专家。
- 获得免费的教材 (银行风险管理和风险建模), 培训, 模型和案例, 食品, 课件, 以及其它一些相关的入门学习资料。

国际专业教育和研究机构 (IIPER) 是一家全球性机构, 其合作伙伴和办公地点包括美国, 瑞士, 香港, 墨西哥, 葡萄牙, 新加坡, 尼日利亚, 马来西亚等等。IIPER的SCRM证书由国际认证委员会认可, IIPER是世界上享有声望的AACSB (美国国际管理教育联合会) 的成员之一。AACSB是最大的由美国教育部授权的认证机构之一, 全世界有500多所商学院都是其成员。此外, IIPER的研究会也获得项目管理机构 (PMI) 的认可, 参与者在完成课程之后可以获得30个PMI认可的专业发展单元 (PDU)。IIPER的国际标准董事会是由来自世界各地许多知名大学的教授组成的, 包括Lehigh大学 (宾夕法尼亚州), 应用科学大学 (瑞士), 海军研究生院 (加利福尼亚), 密苏里州大学 (堪萨斯州) 等等。此外IIPER还与世界很多研究机构结成了战略合作伙伴关系。

CRM 培训课程包括内容

模块 1: 风险分析介绍

- 第 1 章: 培训介绍
- 第 2 章: 如何制订商业决策的?
- 第 3 章: 什么是风险/为何要考虑风险?
- 第 4 章: 风险分析软件应用综述

模块 2: 使用Risk Simulator软件进行蒙特卡罗分析

- 第 1 章: Risk Simulator 软件概述
- 第 2 章: 仿真文档, 假设, 预测和运行仿真
- 第 3 章: 解释预测统计
- 第 4 章: 运行仿真选项和随机数种子
- 第 5 章: 运行报告, 保存, 输出仿真数据

模块 3: 高级仿真技术

- 第 1 章: 相关性和截断仿真
- 第 2 章: 可替换参数
- 第 3 章: 多维仿真
- 第 4 章: 分布拟合
- 第 5 章: 仿真的优点和缺陷

模块 4: 仿真和分析工具

- 第 1 章: 静态飓风图和蛛网图分析
- 第 2 章: 动态敏感性分析
- 第 3 章: 不同分布的假设检验
- 第 4 章: 非参数拔靴仿真

模块 5: 通过Risk Simulator软件进行优化

- 第 1 章: 优化介绍
- 第 2 章: 连续优化
- 第 3 章: 整型优化

模块 6: 预测

- 第 1 章: 预测技术和数据的类型
- 第 2 章: 无数据预测
- 第 3 章: 时间序列分析预测
- 第 4 章: 非线性外推
- 第 5 章: 多元回归分析
- 第 6 章: 随机过程
- 第 7 章: 高级预测: Box-Jenkins ARIMA和自动ARIMA, GARCH, J-曲线, S-曲线, 马耳可夫链, 数据诊断, 统计特性和基本计量经济学应用

模块 7: 实物期权分析:理论和背景

- 第 1 章: 实物期权介绍: What, Where, Who, When, How, and Why?
- 第 2 章: 示例商业应用
- 第 3 章: 不同的期权评估技术: 实物期权和金融期权的比较
- 第 4 章: 风险中性概率技术
- 第 5 章: 解决欧式和美式看涨期权
- 第 6 章: 使用Excel解决基本的欧式和美式看涨期权
- 第 7 章: 解决基本的放弃期权, 扩展期权, 收缩期权, 和选择期权

模块 8: 实物期权分析:应用SLS软件

- 第 1 章: SLS软件不同模块介绍和波动性的估计
- 第 2 章: 波动性估计
- 第 3 章: 改变输入变量解决期权问题和自定义的奇异期权
- 第 4 章: MSLS: 多阶段连续混合期权
- 第 5 章: MNLS: 使用三叉网格, 四叉网格和五叉网格解决均值-回复, 跳跃-扩散, 和双资产彩虹期权
- 第 6 章: 构建实物期权一问题结构化
- 第 7 章: 下一步是什么...

CRM 考试复习

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。