

兰帕德, CFA

工作经历

2014.9 – 今 基金经理, 嘉合基金管理有限公司, 上海.

固定收益部

- 担任公募产品嘉合货币 (001232, 规模 80 亿, 年化回报 2.97%, 排名 205/410) 和嘉合磐石 (001571, 规模 1 亿, 年化回报 10.88%, 排名 7/107) 基金经理
- 开发基于 C# 的分析系统: 实时对产品持仓进行风险分析, 利率和商品市场波动性跟踪

量化投资部

- 协助管理 80 亿规模的量化对冲专户, 提供 Alpha 策略与择时策略, 2015 年化回报平均 15%
- 搭建基于 Python 的量化回测框架: 适用于多品种多数据源, 拓展性强, 运算效率高
- 研究与开发商品期货的量化择时 (分钟频) 及不同品种间的套利策略, 在 CTA 产品中使用

2013.6 – 2014.9 量化分析师, 法国巴黎银行 (BNP Paribas), 上海.

资金部, 经理 (Associate)

- 支持资金部利率互换和外汇交易的日常工作: 改进产品定价工具, 维护数据库系统
- 建立中国区流动性风险模型, 管理内部流动性, 向管理层和监管机构报告

2011.4 – 2013.5 量化分析师, 法国巴黎银行 (BNP Paribas), 新加坡 / 香港.

固定收益研究与策略部, 经理 (Associate)

- 开发衍生品交易策略: 期权的套利策略, 基于随机模型相关性的期权与其他资产配置策略, 基于一揽子货币的外汇套利策略
- 开发和维护基于 C++ 的衍生品 (利率互换, 外汇期权, 信用掉期 (CDS) 期权, 股票期权等) 内部定价模型库, 参与亚太区衍生品组的日常交易工作
- 改进利率与 CDS 混合期权 (hybrid) 的定价模型, 完善亚太区混合期权交易的风险控制系统

2010.7 – 2010.9 量化分析师, 德意志银行 (Deutsche Bank), 伦敦.

全球市场部, 暑期实习 (Summer Analyst)

- 算法交易组: 研究与开发欧洲市场暗池 (Dark Pool) 算法交易策略, 撰写报告并参与路演
- 衍生品交易组: 开发工具监控期权市场的交易机会, 协助报价和管理风险头寸等日常工作

教育背景

2009.8 - 2011.7 金融数学硕士, 巴黎综合理工 (École Polytechnique) 数学系, 巴黎.

专业: 概率与金融 (Probabilités et Finance), 负责人 El Karoui 教授

学位荣誉: 优等 (Assez Bien), 法国外交部奖优秀学生学金

2007.9 – 2009.6 应用数学硕士, 市立纽约大学 (City University of New York) 数学系, 纽约.

学位荣誉: 最优等 (Summa Cum Laude)

2003.9 – 2007.6 经济学学士, 南京大学 经济学院 金融系.

职业技能

计算机 熟练掌握 C++/C/Python/Matlab, 熟悉 Oracle 数据库

外语 流利的英语以及法语听说读写能力, 英语 6 级 (CET-6), 法语 4 级 (TEF-4)