

# 陈思懿

13828730420 | sc4793@columbia.edu | niagu.me

## 教育背景

Columbia University 哥伦比亚大学	纽约, 美国	2025. 12 毕业
运筹学(金融市场方向)	科学硕士	
Columbia University 哥伦比亚大学	纽约, 美国	2022. 5
应用物理学	科学学士	SAT: 1530/1600 总绩点: 3.63 / 4

主要课程: 大学物理学、统计金融、统计机器学习、数据科学、概率论、金融工程

## 工作经历

杭州希格斯投资管理有限公司	权益组合经理	杭州	2023 年 9 月-2024 年 6 月
<ul style="list-style-type: none"><li>开发基于 PCA 隐风险因子、barra 多因子和协整方法的自动组合优化系统, 实现最大指数跟踪误差 1.5% 条件下的优势交易持仓组合策略, 相对全复制组合年化交易回报提高约 5%</li><li>主导权益对冲标的的开发和交易自动化, 实现场内外融券和期货对冲端的自动选优调仓、展期和套利。搭建 Bash 和 Python 最优化对冲规划系统以整合多交易平台融券报价和基差, 中性产品年化对冲成本降低约 1%</li><li>利用网格搜索和回测算法为高频策略作容量分析和展业规划, 开发股衍台和期货商合作以优化交易覆盖和成本, 主导成立了 3 个专户和 1 个创新型灵活对冲子母集合产品, 增量有效管理规模 6 亿元</li><li>主导自营、专户产品的路演和要素商务对接, 获取优化的资金成本和交易资源支持</li></ul>			
	量化交易研究员	杭州	2022 年 10 月-2023 年 9 月
<ul style="list-style-type: none"><li>通过逐笔订单簿分析、特征工程和机器学习对约 15 亿指增和中性产品的高频量化交易进行交易策略优化和交易风控设计, 贡献 3 个高频因子和 10+ 个交易/风控策略升级</li><li>合作开发母单交易系统, 将对交易和风控参数的控制从组合层面细化至个股-时段, 实现个股多时段多类交易灵活控制</li><li>设计和搭建创新交易竞争监控算法, 实现盘中对每笔报单生命周期要素、速率竞争力、标的交易热度、挂撤单周期、开平仓回报归因等指标的实时监控, 要素纳入实盘参数后沪深市平均撤单率降低约 5%</li><li>主导对逐笔订单簿和报单/成交数据流的特征工程, 对实盘高频交易特征和标的的风控指标进行量化分析以贡献对量化交易和风控策略的升级</li></ul>			
南方基金管理公司	数据分析实习生	深圳	2021 年 5 月-2021 年 9 月
<ul style="list-style-type: none"><li>使用 Python 的 NumPy、Pandas 库对基金市场数据进行清洗、统计分析和回测以发掘“固收+”产品系列的市场优势和数据例证, 并用 Matplotlib 可视化以支持路演销售材料, 在任期间二级债基、FOF 于代销行的存量提升约 10%</li><li>利用 R 语言 Arima 模型对基金零售直播作时间序列分析以量化零售直播奖品发放产生的流量增量价值, 优化基金零售直播调整奖品发放策略</li><li>主导 ETF 产品投资者周报和日常公众号运营的数据监控和撰写; 利用 Python 的 Tushare 金融数据 API 为 ETF 周报和投资者教育开发自动监控软件, 涵盖行业基本面、宏观指数等, 在职间节省 95% 数据整理时间</li></ul>			
招商证券	投资银行实习分析员	上海	2018 年 12 月-2019 年 2 月
<ul style="list-style-type: none"><li>参与某半导体公司于上海 A 股科创板 10.1 亿人民币规模 IPO 初审前的招股书底稿整理与撰写, 协助分析师进行多个供应商的尽职调查和函证访谈。尽调结果被用于撰写招股书“采购及主要供应商情况”</li><li>独立进行财务分析: 使用万得数据终端对同业微电子公司作同业研究。通过财务及同业数据对偶发性关联交易流动性增长进行归因。加快了招股书“同业竞争”、“资产质量分析”及“关联交易”部分的完成</li><li>辅助内核穿行测试、财务数据整理及会议演示文稿的准备, 辅助 VP 进行主板转科创板的企业高管辅导</li></ul>			

## 项目经历

欧柏林金融投资	分析员	欧柏林, 美国	2018 年 2 月-2020 年 5 月
<ul style="list-style-type: none"><li>为 36 万美元投资组合制定股权投资战略和股权研究, 每周使用 Excel 与 Bloomberg 终端追踪投资组合损益情况, 制作投资组合表现季度报告, 在任期间投资组合产生 30% 净增长</li><li>使用彭博终端与公开数据进行证券研究, 使用现金折现等估值模型对大盘股作价值筛选并作周度选股推荐</li></ul>			

## 技能爱好

编程/量化技能: Python、Linux Bash、SQL、机器学习应用、时间序列、WIND/BLOOMBERG 终端 API

外语: 英语(无障碍, 托福: 110/120, SAT: 1530/1600)

兴趣: 健身、主观交易(对 twap 历史胜率超 50%)、语言学习、拳击