

袁霄羽

Tel: (+86)18012724642 (微信同号)
Email: 13625276951@163.com

基本信息

性别：男
就读院校：同济大学
年级：本科 2026 届
专业：金融

成绩及获奖

GPA: 4.77 排名 4/53, 7.55%
荣誉及获奖：同济大学校一等奖学金
同济大学大学生数学竞赛三等奖

实习经历

银河德睿 场外衍生品部 交易助理 2024/07 -

i) 协助组内对冲交易相关工作，根据现有策略，编写回测框架，分别利用个股与股指等不同标的的对个股期权 delta 进行对冲，对策略表现进行归因分析，基于回测结果结合多种思路对现有策略进行改进，翻正 Sharpe。

ii) 协助开发组内期权自动对冲交易系统。基于多个平台编写接口，与对方开发进行充分沟通，按照不同平台特性 debug 交易程序。完成基于 PyQt5 的对冲进程可视监测，并进一步拓展功能，如：按客户要求自动平仓指定合约，完善合约组合管理等。

iii) 协助组内日常研究与开发工作所需 python 模块开发工作。

国金证券 金融创新部 2024/01 - 2024/06

i) 通过复现论文及研报，对比优化不同算法，编写了 1) 基于 MC 模拟的多类型雪球收益率敲定；2) 基于 FFT 的欧式香草期权定价与 Greeks 计算程序，数倍提高了期权定价计算效率。

ii) 编写并维护代码，完成项目 1) DMA 客户业绩信息的自动计算与处理；2) 基于 scipy、cvxpy+Gurobi 等最优化求解器的上市公司财务报表自动化还原，作为因子挖掘的辅助模块。

iii) 完成满足组内其他特定工作需求的 Python 模块，协助开展各类业务。

项目经历

HKUST 量化竞赛 鬼才工坊队 策略研究 + 量化开发 2024/09 -

赛前独立完成起始策略构建，并搭建回测框架。参考中金、兴业与东吴有关港股与量化多因子的多篇研报，对研报进行复现。考虑恒生近期表现，策略采用多因子+alpha 对冲，按日频进行调仓。基于 akshare api 独立搭建回测框架，大幅简化因子编写与测试方法。回测期 6-8 月，年化收益率 4.38%，sharpe 0.58。目前正在尝试利用树模型类机器学习组合因子，优化结果。

数学建模 国赛 基于线性规划模型的农业种植策略研究 2024/09

模型构建与程序实现。构建最优化问题模型，并在保证模型对问题求解能力不变的基础上，对模型进行简化，将问题由整数规划优化为线性规划，并化简约束条件；利用蒙特卡洛法，SAA 求解随机规划。并利用 matlab、python 进行编程：利用 matlab+Gurobi 实现并求解模型，同时完成结果的可视化。

数学建模项目 基于机器学习的股价预测与投资组合优化 2024/05 - 2024/06

根据股票历史数据进行建模，预测未来股价。完成股票历史数据收集、数据预处理的部分，进行了特征工程，根据股票技术指标与构造了部分技术指标与 alpha，并尝试了 PCA 等方法，探索变量处理方式。通过数据可视化、相关性分析等方法进行 EDA。进行模型训练，对比使用随机森林、MLP 与 LSTM-时间序列算法，根据不同模型调节超参，评估模型准确性。最后根据预测结果构造交易策略，创造 7% 的超额年化收益率。

大创（国创）项目 基于金融大数据的公司估值方法比较研究 2024/02 -

完成基于 NLP 文本分析技术的市场情绪分析。通过爬虫爬取网络文本，利用 Python 进行情感分析，主要对比了微调 BERT 及 ERNIE 预训练模型的深度学习方法、基于 SnowNLP 库与遍历情感字典的情感分析方法，在耗时相近的条件下将分析准确率提高了 10%。进行基于机器学习的公司估值模型建立，利用随机森林、SVM 等模型进行训练，计算基于大数据得出的公司估值与预期股价。

社团经历、班委经历

同济大学吉他协会、青年摄影师协会干事
班级就业联络人