

# 谢润坤

(+86) 188-1017-5171 | [XieRunkun@126.com](mailto:XieRunkun@126.com) | [Runkun.Xie@Columbia.edu](mailto:Runkun.Xie@Columbia.edu)



## 教育背景

哥伦比亚大学	金融数学专业	理学硕士	2018.09 - 至今
<ul style="list-style-type: none"><li>GPA: 4.00/4.33, 荣誉奖项: Davis 奖学金</li><li>主修课程: 金融随机分析、金融数值方法、非线性期权定价、时间序列分析、机器学习等。</li></ul>			
中央财经大学	金融工程专业	经济学学士	2014.09 - 2018.07
<ul style="list-style-type: none"><li>GPA: 3.87/4.00, 排名: 专业 10%</li><li>主修课程: 衍生品与动态金融、金融数值计算、金融工程、实证金融、实变函数、微分方程等。</li><li>荣誉奖项: “经叔平教育基金”奖学金 (0.5%)、鸿儒奖学金 (1%)、全面发展奖学金一等奖 (2%)</li></ul>			

## 实习经历

银河证券 CGS	衍生品部门 / 量化研究实习生, [Python]	2018.02 - 2018.06
<ul style="list-style-type: none"><li>设计与搭建基于矩阵运算的回测框架, 系统组成包括单因子有效性检测、风险预测、收益预测、权重优化;</li><li>测试和挖掘 50 余个短期因子, 利用投资组合优化理论构建多因子策略并进行回测;</li><li>利用随机波动率模型拟合隐含波动率曲面, 并用于期权定价。</li></ul>		
中金公司 CICC	财富研究部 / 私募数量分析实习生, [Python、VBA]	2017.10 - 2018.01
<ul style="list-style-type: none"><li>进行基金业绩不同主题的研究并进行汇报, 主题涵盖风险分析 (Barra 模型)、业绩归因分析 (Brinson 模型)、业绩持续性分析 (概率转移矩阵)、风格行业转换分析、子基金相关性分析等;</li><li>收集整理私募基金数据, 对 47 只私募基金的持仓数据进行量化分析, 并撰写周度报告。</li></ul>		
金耀投资有限公司	投资研究部 / 量化研究实习生, [Matlab]	2017.07 - 2017.09
<ul style="list-style-type: none"><li>协助基金经理进行交易策略的构思、回测与分析, 编写了动量反转、多因子等策略的回测程序;</li><li>协助搭建、维护交易及信号系统, 利用 HeidiSQL 数据库进行交易信号和模型指标的编写;</li><li>根据 MSCI 方法论构造 6 个风险收益因子指数, 计算单因子风险溢价, 构建交易策略并回测。</li></ul>		
标准普尔 Standard & Poor's	风险管理部 / 金融风险分析实习生, [Matlab]	2017.05 - 2017.07
<ul style="list-style-type: none"><li>参与国内大型保险公司的风险管理项目, 对 19 家对手方公司进行独立评级;</li><li>进行评级调查, 使用打分卡模型和 Capital IQ 数据库进行信用评级, 并参与评级报告撰写与展示;</li><li>学习标准普尔评级方法论和巴塞尔协议III, 并协助处理企业违约率数据。</li></ul>		

## 学术项目

非线性期权定价	哥伦比亚大学, [Python]	2019.02 - 2019.05
<ul style="list-style-type: none"><li>使用基于非线性偏微分方程模型的期权定价理论进行衍生品估值与定价, 包括基于 Longstaff-Schwartz 方法的美式期权定价、基于 HJB 方程和 BSDE 的投资组合权重优化、基于粒子方法和 SLV 模型的隐含波动率估计等。</li></ul>		
金融风险管理课程项目	哥伦比亚大学, [Python]	2018.10 - 2018.12
<ul style="list-style-type: none"><li>构建风险计量系统, 使用蒙特卡罗、参数模拟、历史模拟法估计股票期权组合的在险价值 VaR 和预期损失 ES。</li></ul>		

## 学术活动

《神经网络和深度学习在量化投资中的应用》	中央财经大学, 毕业论文	2017.11 - 2018.05
<ul style="list-style-type: none"><li>将深度学习模型 (ANN、RNN、LSTM 等) 应用于股指预测, 与传统时间序列模型进行对比, 并构建交易策略。</li></ul>		
《过度自信下的社交网络模型》	中央财经大学, 卓越人才培养计划	2016.10 - 2017.06
<ul style="list-style-type: none"><li>将理性预期均衡模型和信息传播网络结合, 建立数学模型, 并利用蒙特卡洛模拟求数值解。</li></ul>		

## 素质技能

计算机	Python、Matlab、C/C++、Excel VBA、SQL; R、SAS、Stata、SPSS; Wind、Bloomberg
职业证书	CFA Level 1、FRM Level 1、SAS 全球初级/高级认证、基金从业资格证
网络课程	机器学习、深度学习、Python 数据分析、算法分析、数据分析工具
实践活动	美国大学生数学建模竞赛一等奖, 挑战杯大学生创新创业训练项目国家级立项