

庄源

更新于 2024 年 11 月 23 日

硕士研究生（三年级），专业：精算学

南开大学金融学院精算学系

天津市津南区海河教育园区同砚路 38 号

邮箱: yuanzhuang@mail.nankai.edu.cn

个人主页: <https://yuanzhuang.xyz/>

研究方向

- **精算数据科学**: 机器学习方法及其精算应用, 保险大数据分析
- **死亡率与生命表**: 死亡率预测, 死亡率修匀, 长寿风险管理
- **量化投资**: 实证资产定价, 高频交易

教育背景

南开大学 金融学院 硕士

2022.09 - 至今

- 精算学 导师: 张连增教授
- **GPA**: 94.6/100 **年级排名**: 1/53 **全院排名**: 1/165

西南财经大学 保险学院 本科（现并入金融学院）

2018.09 - 2022.07

- 保险学（精算双语实验班）
- **GPA**: 90.1/100 **排名**: 3/34
- **毕业论文**: 中国老年人健康预期寿命测度与分解研究

论文发表

1. “偿二代”下非寿险最低资本相关矩阵情景分析—基于最接近相关矩阵的正交试验. 张连增, 庄源. 保险研究, 2023(07):3-16.
2. 城乡居保“开源”还是“节流”? ——财政补贴与提高待遇领取年龄的精算评估. 张连增, 高天, 庄源. 2023 年第二十届北大赛瑟 (CCISSR) 论坛
3. 气候变化下的洪涝灾害机器学习预测. 罗来娟, 庄源, 张连增. 2024 年巨灾保险与灾害风险保障体系建设论坛
4. What KAN Mortality Say: Smooth and Interpretable Mortality Modeling Using Kolmogorov–Arnold Networks. Lianzeng Zhang, Yuan Zhuang. *ASTIN Bulletin* (Corresponding Author, Under Review), 2024.

5. Assessing Regional Flood Risks under Climate Change: A Machine Learning and Spatial Clustering Approach. Laijuan Luo, Lianzeng Zhang, Yuan Zhuang. *The Geneva Papers on Risk and Insurance – Issues and Practice* (Corresponding Author, Under Review), 2024.

科研项目

新能源智能网联车险费率因子与风险预测研究（主持） 2023.04 - 2024.07

- 天津市研究生科研创新项目，参与人：周峥、车俊彦、高天、岳梦雅

气候变化下的死亡率模型研究：机器学习视角（主持） 2020.10 - 2021.10

- 国家级大创，参与人：沈怡、骆佳、王鑫鑫

区块链与财会领域：基于信任成本视角（参与） 2019.10 - 2020.10

- 国家级大创，主持人：马雪怡

参与教材教改项目

中国精算师考试：《精算数学习题解答》（主编：张连增） 2023.11 - 至今

中国精算师考试指定用书：《精算数学》（主编：张连增） 2022.11 - 至今

日本 2018 年寿险业经验生命表的编制过程（负责人：孙佳美） 2023.05

实习与行业项目

实习

普华永道精算审计及精算咨询服务部 2022.01 - 2022.03

富德生命人寿精算部 2021.08 - 2021.11

泰康人寿财务精算企划部 2021.06 - 2021.08

参与行业项目

新能源车“三电”系统数据与赔付相关性研究 2023.03 - 2023.11

互动式保险与疾病发生率和病死率 2022.10 - 2023.05

荣誉及奖励

荣誉称号

南开大学优秀共青团员 2024.05

南开大学金融学院“五四青年标兵” 2024.05

南开大学三好学生 2023.10

北美精算师协会准精算师（ASA） 2022.12

四川省优秀大学毕业生 2022.03

西南财经大学优秀大学毕业生 2022.03

西南财经大学“五四青年标兵” 2021.05

西南财经大学艺术团优秀团员 2020.10

西南财经大学社会实践优秀个人 2019.03

比赛获奖（省级及以上）

“寿再青骏杯”研究生案例大赛 冠军	2023.08
上海智能新能源汽车大数据竞赛 二等奖，平安之星	2022.12
全国大学生电子商务三创赛 四川省一等奖	2021.08
全国大学生艺术节 国家金奖	2021.05
美国大学生数学建模竞赛 <i>FINALIST</i>	2021.05
<i>SOA CASE STUDY</i> 全球前 16 名	2021.01
汇丰银行财经挑战赛 三等奖，优秀个人	2020.12
<i>CAS</i> 全国精算数据分析大赛 二等奖	2020.11
全国大学生数学建模竞赛 四川省二等奖	2020.11
四川省大学生艺术节 一等奖	2020.10
“慕尼黑再保险杯”精算竞赛 <i>Top 100</i>	2020.05

奖学金

国家奖学金	2023.10, 2024.10
南开大学一等学业奖学金	2023.10, 2024.10
南开大学推免奖学金	2023.09
富德生命人寿奖学金	2022.05
招商银行奖学金	2021.12
西南财经大学精算奖学金	2021.10
西南财经大学学业奖学金	2018 - 2022
西南财经大学文体奖学金	2019 - 2021

学生工作

西南财经大学交响乐团 学生指挥，副团长	2020.01 - 2021.05
西南财经大学 单簧管、双簧管演奏员	2018.09 - 2022.04

助教工作

机器学习与 <i>R</i> （优秀助教）	2023 春季学期，张连增教授
精算建模（优秀助教）	2023 秋季学期，张连增教授
精算概论（优秀助教）	2024 春季学期，陈孝伟教授
大数据精算与 <i>Matlab</i> 编程（优秀助教）	2024 春季学期，陈孝伟教授
保险投资与金融市场（优秀助教）	2024 春季学期，陈孝伟教授

技能

编程语言或编程工具：Python, R, MATLAB, Java, VBA
排版/图片/视频编辑软件：L^AT_EX, Photoshop, AE
商用/半商用软件：Prophet, AXIS, Tableau
语言：普通话，粤语，英语，德语

爱好：古典音乐，烹饪（粤菜与川菜），园艺与植物分类学

运动：游泳，网球，瑜伽

乐器：钢琴，单簧管，双簧管

个人公众号：半个精算师（很久不更新了）