**董事、监事及高级管理人员情况调查表**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **姓　　名** | | 曹发 | | | | **性　　别** | 男 | | **婚姻状况** | | 已婚 |
| **出生**  **年月日** | | 1983.02.20 | | | | **身份证件号码** | 370282198302205112 | | | | |
| **是否有基金从业资格** | | 有 | | | | **职务** | 风控总监 | | | | |
| **最后毕业院校** | | 华中科技大学 | | | | | **专业及学历学位** | | 应用化学，硕士 | | |
| **职务：包括担任董事，监事，高级管理人员以及其他任何职务**  **工作单位：包括境内、境外各种单位、组织** | | | | | | | | | | | |
| **起止年月（自首次工作之日起填写）** | | | | **学习或工作单位全称** | | | | | | **职务或工作内容** | |
| 2008.7~2013.04 | | | | 武汉锋迅投资管理有限公司 | | | | | | 交易员 | |
| 2013.04~2015.07 | | | | 智汇量化投资有限公司 | | | | | | 策略研究员 | |
| 2015.08~2017.3 | | | | 青岛美泰科技有限公司 | | | | | | 研究员 | |
| 2017.11~今 | | | | 青岛矩信宏元投资管理有限公司 | | | | | | 风控总监 | |
| **是否对外投资的公司、企业或其他经济组织** | | | | | | | | | | | |
| **对外投资单位名称** | **在对外投资单位的投资金额（万元）** | | **在对外投资单位所占股权比例（%）** | | **在对外投资单位所任职务（在对外投资单位担任董事、监事、高管）** | | | **对外投资单位的经营范围** | | | |
| 无 |  | |  | |  | | |  | | | |
| 无 |  | |  | |  | | |  | | | |
| **备注：若无对其他单位投资，也请填无；仅在其他单位担任董监高，未持有股权，也请填写单位名称及所任职务** | | | | | | | | | | | |
| **简历：**  **曹发，毕业于华中科技大学，应用化学专业硕士；投资交易市场涉及A股，美股，商品期货，黄金和外汇等众多市场；擅长阿尔法策略、对冲策略、无风险套利策略以及CTA策略；熟悉TB，MT4等量化投资平台，熟练Matlab，Python，MQL4及C等编程语言，擅长数据挖掘分析；有大量建模交易经验；**  **1.青岛矩信宏元投资管理有限公司：**   * **负责公司投资策略及交易风险控制；** * **梳理交易流程，优化风控策略及自己管理策略；** * **交易模型搭建，测试；** * **建立风险评估标准，监督投资交易运行；** * **培养管理风控团队；**   **2. 智汇量化投资有限公司：**   * **负责公司两个套利策略的运行监控及优化；** * **梳理交易流程，完善资金管理策略及风险控制策略；** * **交易外汇，黄金及期货等标的；** * **新建一套趋势投资策略，分别运行于外汇市场和黄金市场；** * **回测5年，平均年化收益36.8%，最大回撤8.6%；** * **IR值分别为0.31,0.28，具有很好的稳定性能；** * **实盘运行半年，收益15.6%，最大回撤3.6%；和模拟测试基本吻合；** * **建立了交易模型测试评估系统，可对交易模型进行加压高强度测试；** * **该策略交易思想正在移植到股市和期货市场中进行测试；**   **3. 武汉锋迅投资管理有限公司**   * **分析行情，做出每日交易总结及下一交易日交易计划；** * **按交易机会进行操盘，把握市场机会；** * **构建交易策略；** * **交易美股和A股；** * **刷单，套利，程序化交易；** * **主要用C语言编写数据分析程序，寻找市场套利、投机机会；** * **初步模型建立及测试，风险评估等；**   **4. 青岛美泰科技股份有限公司**   * **生产工艺设计；** * **生产研发数据分析；** | | | | | | | | | | | |

**签字：**

**年　　月　　日**