



董驰

作为一名应届博士毕业生, 董驰正积极寻求金融产业中的量化分析及研究方面的职业机会

数学 • University of Alberta

男 | 1986.06 | 博士 | 应届毕业生 | 深圳

13720295626 | dongchi86@outlook.com

实习经历

University of Alberta

助教

2012.09-2017.04

工程师微积分 (Math 100, Math 101) 习题课讲师 辅导微积分和线性代数

University of Alberta

助理研究员

2012.09-2017.07

详情请参见我的个人网站 dongchi86.wixsite.com/en-us/research

Florida Atlantic University

助教

2009.08-2012.06

微积分方法讲师 (MAC 2233) 三角学讲师 (MAC 1114) 大学代数讲师 (MAC 1105) 辅导微积分, 线性代数和统计学

教育经历

University of Alberta

博士 • 数学

2017年毕业

Florida Atlantic University

硕士 • 数学

2012年毕业



■ 项目经验

Replication and Markov Processes

助理研究员

2015.07-至今

关键词:Markov process on general space, replication, Ray-Knight compactification, invariant measure

论文:Dong, C. and Kouritzin, M. A. (修订中). Replication, Markov Processes and the Ray-Knight Theory .

Filtering Equations with Signal-Noise Correlation

助理研究员

2012.09-至今

关键词:filtering equation, correlated noise, weak solution 摘要:In the classical setting of nonlinear filtering problem, the random noise of observation is often assumed independent of the signal. This project focuses on generalizing the classical Fujisaki-Kallianpur-Kunita equation and Duncan-Mortensen-Zakai equation to the case where the signal and observation are driven by correlated Wiener processes. 论文:Dong, C. and Kouritzin, M. A. (修订中). "On stochastic filtering equations for correlated signals and noises".

LAD Estimations for SDE Driven by α -Stable Noises

研究生

2011.12-至今

关键词:LSE, LAD, α -stable process, generalized O-U process, long-time behavior of estimator 摘要:Concerning the infinite variance cases, self-weighted LAD technique is employed herein to estimate the parameters in certain types of generalized Ornstein-Uhlenbeck processes. Some results have been established for O-U processes with relatively large dispersion rate (e.g. take it to be 1) and the long-term (observation duration tends to infinity) behaviors of the estimator. The ongoing and future work focuses on the case of very small dispersion rate (tending to zero). 论文:Dong, C., Kouritzin, M. A. and Long, H. (修订中). "LAD estimations for stochastic processes driven by α -stable noises".

Replication and Approximate Filters

助理研究员

2016.04-2017.09

关键词:non-compact space, approximate filter, long-time behavior, convergence to stationary filter

论文:Dong, C. and Kouritzin, M. A. (已投稿). On Convergence of Approximate Filters to Stationary Filters .

研究海报: Nonlinear Filters and Their Long-Time Behaviors on Completely Regular Spaces . 加拿大统计协会2014年年会.

Replication and Martingale Problems

助理研究员

2013.05-2017.07

关键词:martingale problem, stationary solution, existence, uniqueness, weak convergence

论文:Dong, C. and Kouritzin, M. A. (已投稿). Solving Martingale Problems in General Settings .

简历来自: 拉勾网 - 最专业的互联网招聘网站 - www.lagou.com

Replication and Nonlinear Filtering

助理研究员

2013.05-2017.07

关键词: general state space, filtering equation, existence, uniqueness, stationary distribution, stationary signal-filter pair

论文: Dong, C. and Kouritzin, M. A. (已投稿). On Filtering Equations and Stationary Solutions .
The Approach of Replication

助理研究员

2013.05-2017.05

关键词: replication, compactification, probability measures, base, tightness, weak convergence

论文: Dong, C. and Kouritzin, M. A. (已投稿). Replication and Its Application to Weak
Convergence .

研讨班报告: The Replication of Stochastic Processes . 太平洋数学科学研究所随机数学博士后2015研
修班.

投稿报告: Replication and Approximation of Stochastic Processes in Generalized Spaces . 加拿大
统计协会2015年年会.

■ 自我描述

作为一名应届博士毕业生, 董驰正积极寻求金融产业中的量化分析及研究方面的职业机会。

董驰在中国、美国和加拿大三地接受了纯数学、概率论、随机过程及统计学方面的扎实训练。在武汉大学(武汉, 中国)完成本科学习后, 董驰曾在佛罗里达大西洋大学(博卡拉顿, 美国)作博士研究生, 后转入阿尔伯塔大学。他拥有武汉大学统计学学士、佛罗里达大西洋大学数学硕士(导师龙红卫博士)以及阿尔伯塔大学数学博士(导师 Michael A. Kouritzin 博士)。

在理论方面, 董驰专注于概率论及其相关领域, 包括(但不限于): (1) 拓扑空间上的概率测度和随机过程的一般理论; (2) 随机过程的收敛; (3) 随机(尤其是马氏)演化系统。他和 Kouritzin 博士共同发展了复制方法。该方法作为一个综合工具系统, 可用于简化各类概率问题中的拓扑和测度论方面的技术困难。

在应用方面, 董驰主要研究(但不限于): (1) 非线性滤波问题(一种典型的隐马模型), 包括滤波方程、平稳滤波器、长期典型行为以及相关的收敛问题等; (2) 蒙特卡洛方法, 粒子滤波器和分支系统。以上课题在信号探测、参数估计、贝叶斯模型选择、金融市场微观结构模型、在线金融衍生品定价、大型随机系统的快速仿真以及基因学等方面均有应用。

董驰撰写的一系列论文已临近发表。他亦数次在知名的学术会议上作报告, 并获得多项奖学金和研究资助。此外, 董驰在研究生学习期间兼任助教或研究助理, 从中积累了专业合作, 知识转移和辅导方面的经验。

董驰生于中国武汉市, 母语中文, 英语流利。

■ 期望工作

研究分析类岗位, 全职, 深圳, 15k-25k

接受合适的实习生, 培训生等机会

简历来自: 拉勾网 - 最专业的互联网招聘网站 - www.lagou.com

■ 技能评价

Excel



MATLAB



R & R Studio



C++



Python



■ 附加信息

个人网站: dongchi86.wixsite.com/en-us 其它研究论文: Dong, C. (2007). A Discussion of Boarding Process --- Detailed Optimal Strategies of Boarding Processes. 会刊, 第三届东亚工业与应用数学协会年会. 其它演讲报告: A Discussion of Boarding --- Detailed Optimal Strategies of Boarding Processes. 投稿报告, 第三届东亚工业与应用数学协会年会. 部分获奖: 理学院优秀答辩奖. 阿尔伯塔大学, 08/17. Josephine M. Mitchell GS4 夏季研究资助. 阿尔伯塔大学, 12/12及03/16. 学生旅行奖金. 加拿大统计协会2014及2015年年会. 研究生教学奖. 阿尔伯塔大学, 03/15. 最佳学生海报. 概率分会, 加拿大统计协会2014年年会. Pundit RD Sharma 数学与统计科学纪念奖学金. 阿尔伯塔大学, 01/13. 阿尔伯塔大学博士录取奖学金. 阿尔伯塔大学, 09/12. 竞赛奖学金. 武汉大学, 04/07. Honorable Mention. 2007美国大学生数学建模竞赛.