



陶韵南

(+86) 153-1781-7872

yunnant95@gmail.com

<https://www.linkedin.com/in/yunnan-tao/> | taoyunnan.me

教育背景

2017.09-2018.12	康涅狄格大学	金融数学-金融风险管理 (STEM)	硕士
• 课程涵盖：风险计量，风险管理，时间序列分析，衍生品定价，Python，R等			
2013.09-2017.07	天津财经大学	金融工程	学士
• 课程涵盖：金融工程，数理金融，计量经济学，经济学，统计学，会计学，Matlab，SAS，R等			

工作经验

2020.02- 至今	1688 Capital LLC	交易部门 量化交易员
• 交易加密货币和加密货币期货。研究并分析潜在的贸易机会。• 开发和维护数据获取系统和数据生成器系统，使用Python和SQL处理Tick，Candle和Trade数据。• 在Backtrader和VNPY系统上研发趋势，反转，套利和震荡的Python交易策略。• 每周优化策略，并开发自动报告系统。• 开发在AWS Linux上运行的交易机器人，集成了Telegram通知。		
2019.05-2020.02	BH Asset Management LLC	量化部门 量化分析师
• 使用SQL清理了交易和市值数据，运用VBA计算和分析收益和风险指标。• 建立多因子分析进行业绩归因。• 根据风险，收益和税赋为帐户构建分配优化分析。• 建立投资组合再平衡以减少Tracking Error并提高Alpha。• 为每个投资组合建立VaR模型，以评估当前头寸的风险。		
2018.05-2018.11	安永	FSO精算咨询 机器学习学生研究员
• 通过搜集个人基本信息，运动饮食等行为数据，使用机器学习建立个人身体状况评分（使用R进行Logistic回归，SVM，随机森林等）来估计患有糖尿病的可能性，从而确定保费。• 使用R (Shiny) 设计用户界面，并使用Google Cloud Linux在网站和Android上部署该模型和用户界面。		

项目经验

2019.03-2019.10	South Stone 量化交易系统	负责人
• 基于开源Python项目VNPY构建了一个用于交易和回测的量化系统，并部署在阿里云Linux Server上。• 研发加密货币和CTA策略（趋势，逆转和震荡）和算法交易策略（冰山，做市和套利）。• 建立了一个网站（Vue.js，Flask）来控制，监视和分析策略，使用钉钉机器人通知。		
2018.01-2018.03	康涅狄格大学 动量策略和风格分析项目	负责人
• 对不同国家市场的市场收益进行回归分析，分析模型统计指标。• 在不同的市场上用Python进行动量策略的回溯测试，并分析差异。• 进行案例研究，以解释市场异常和不同市场上策略有效性的不同的原因。		
2015.10-2016.10	天津财经大学 大学生情绪指数量化研究	负责人
• 搜集大学生和大众投资者的相关情绪指标，使用主成分分析法构建出情绪指数，并确定情绪指数能够一定程度预见股市走势。• 带队完成问卷调查，使用网络爬虫搜集数据，构建和编程模型，以论文形式汇报工作。		

竞赛获奖

- 研究生优秀毕业结项 第一名 (2018) • 亚太数学建模竞赛 二等奖 顾问 (2017) • 全国数学建模大赛 (CUMCM) 全国二等奖，省一等奖 (2015) • 美国大学生数学建模大赛 (ICM) S奖 (2015) • 第四届“中金所”杯全国大学生金融及衍生品知识竞赛 优胜奖 (2016) • 天津财经大学“安信证券”杯模拟炒股大赛 第六名 (2015) • 优秀团员，优秀干部，多次获得奖学金 (2015,2016) • 青少年信息学竞赛 (NOI) 省级二等奖 (2010)

技能证书

- 完全胜任Matlab，Python，VBA，R，SQL相关任务；熟练使用SAS，SPSS；熟悉C++，JS
- 熟练运用 金融学，统计学，会计学，数据分析，计量模型；熟悉运用分析机器学习模型
- 熟练使用 算法，数据结构，爬虫，量化平台，Bloomberg，Wind，Tableau，Linux
- 熟悉量化投资，算法交易，低延迟交易，套利，股权，加密货币，组合管理，优化
- CFA1级，FRM1级，彭博认证，计算机语言C二级，基金从业

个人自评

基于扎实的金融背景和计算机模型编程的实战，对于金融及金融建模问题，能够通过数理分析，量化建模和熟练编程处理解决，有一定的经验和能力。优势是金融与计算机并重发展，能够优异完成两学科交叉任务。多次参加团队竞赛，有很好的协作沟通和一定的领导能力。