



陶韵南

1995.03.04 辽宁大连

199.6937.0519 | [yunnant95@foxmail.com](mailto:yunnant95@foxmail.com)

<https://www.linkedin.com/in/yunnan-tao/> | <https://yunnant.github.io/>

## 工作经验

2022.08-至今	英大基金	上海分公司   研究员	上海
	英大资本	资管部门   研究员	上海
• 作为FOF研究员尽调私募基金，研究大类资产和组合配置。• 作为债券研究员撰写信评报告，管理债券出入库。• 作为量化研究员完善大类择时模型，多因子债券基金模型，多因子权益基金模型并跟踪模拟组合，研究并初步完成国债期货跨期套利模型，净值型雪球模型，固收+模型，转债多因子模型等。• 协助完成公司风控穿透和流动性测试报告。			
2021.07-2022.08	国网英大长三角金融中心	资管部门   FOF量化研究员	上海
• 尽调私募基金，研究大类资产和组合配置。• 初步构建大类择时模型，多因子债券基金模型，多因子权益基金模型，策略择时模型并跟踪模拟组合。• 构建部门数据库，开发程序自动化基金运营流程，参与对子基金的尽调。• 撰写对外月报周报。			
2020.02-2021.05	1688 Capital LLC	交易部门   量化交易员	波士顿，美国
• 研究并分析加密货币和加密货币期货交易机会。• 开发和维护数据获取系统和数据生成系统，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，套利的Python交易策略。			
2019.05-2020.02	BH Asset Management LLC	量化部门   量化分析师	格林威治，美国
• 使用SQL清理原始数据，运用VBA计算收益风险指标。• 建立多因子分析进行业绩归因。• 根据风险，收益和税赋等为帐户构建分配优化分析。• 建立Rebalancing以减少Tracking Error并提高Alpha。• 为投资组合建立VaR模型评估头寸风险。			

## 教育背景

2021.09-至今	佐治亚理工学院	计算机科学-机器学习硕士 (OMSCS)	在线
• 课程涵盖：机器学习，深度学习，增强学习，机器学习在交易的运用等			
2017.09-2018.12	康涅狄格大学	金融数学-金融风险管理硕士 (STEM)	美国
• 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。• 研究生优秀毕业结业 第一名			
2013.09-2017.07	天津财经大学	金融工程学士	天津
• 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			

## 项目经验

2015.06-2022.08	家庭资产管理	负责人	
• 7年a股大资金（300万元）交易管理经验，了解行业分析模式。持续跑赢指数，2020年年收益率40%。			
2019.03-2019.10	South Stone 量化交易系统	负责人	
• 基于项目VNPY构建了一个用于交易回测的量化系统，并部署在Linux服务器上。• 研发加密货币和CTA策略(趋势，反转)和算法交易策略(冰山，做市和套利)。• 建立网站(Vue.js, Flask)来控制，监视和分析策略，使用钉钉机器人通知。			
2018.05-2018.11	安永咨询-大数据健康研究生毕业项目	研究员	
• 通过搜集个人基本信息和行为数据，使用机器学习建立身体状况评分（包括Logistic回归，SVM，随机森林等）来估计患有糖尿病的可能性，从而确定保险费。• 使用R (Shiny) 设计用户界面，并在网站和Android上部署该模型和用户界面。			

## 竞赛获奖

- 参与管理产品获私募排排网年度资管产品收益前五（2023）• 研究生优秀毕业结业 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（共600人）（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Python，Matlab，VBA，R，SQL数据库相关任务；熟悉使用C++，C#等编程语言
- CFA1级，FRM1级，彭博认证，计算机语言C二级，基金从业