

## 郑子辰

24岁 | 北京 | 男 | 一个月内入职

电话: 18511535525

邮箱: zichen.zheng@rutgers.edu



### 自我评价

拥有扎实的数学、统计学和金融教育背景，以及对 Python, R, Excel 的熟练掌握和运用。精通英语听说读写，在美留学六年，面对新知识、新技术拥有极强的学习与适应能力。能有效地与团队成员沟通、协调，在团队环境中积极贡献自己的力量。

### 教育背景

#### 罗格斯大学, New Brunswick, NJ, USA

硕士, Mathematical Finance, 3.50/4.00

**Relevant Coursework:** 量化金融, 数值分析, 计量经济学, 数据挖掘, 高等金融模拟, 大规模金融行业事件分析

2022 - 2024

#### 罗格斯大学, New Brunswick, NJ, USA

本科, Mathematics, Minor in Economy, 3.07/4.00

2018 - 2022

### 工作经历

#### EF 英孚教育, 北京, 中国

外教助理

2022

- 在教学过程中协助外教, 需要时代替外教进行简单的教学任务
- 帮助外教和学生、学校其他员工之间的沟通, 解决因语言差异带来的障碍。在需要时, 提供口译或书面翻译服务。
- 提供对学生的学术支持和辅导, 参与学生作业和考试的批改评估。

### 硕士毕业研究项目 (基于 S&P 500) [论文链接](#)

#### 对比风险价值模型(VaR): Implied vs. Historical Volatility 对于预测金融危机的作用

9月 - 12月, 2023

- 使用隐含波动率(Implied Volatility)和历史波动率(Historical Volatility)进行风险价值(VaR)模型比较分析, 以评估它们在 2020 年 COVID-19 金融危机期间的有效性
- 在此基础上, 比较 VIX(基于隐含波动率)和 GARCH(1,1)模型(基于历史波动率)的有效性
- 专注于 GARCH(1,1) 模型, 探索该模型捕捉时间变化波动性(time-varying volatility)的能力, 以及 GARCH(1,1)模型在 2020 年 COVID-19 危机期间预测波动性的应用
- 突出 GARCH(1,1) 模型在模拟波动聚集(volatility clustering)及其动态性方面的优势

### 其他研究项目

#### 针对平凡亚式期权(Vanilla Asian Option)和回望期权(Lookback Option)的 Delta 对冲

2月 - 5月, 2023

- 应用希腊值公式(Greeks formula)来找出平凡亚式和回望期权的 Delta
- 创建两个自筹资金的投资组合, 使其与两个期权的初始价格相同
- 通过展示基于不同布朗运动值(Brownian Motion)的投资组合价值的路径与和其对应的平凡亚式和回望期权价格相吻合, 证明德尔塔对冲(Delta Hedging)将会奏效。

### 技术及其他技能

**核心领域专长:** 统计建模、量化分析、编程、财务分析、对冲交易, Delta 对冲

**计算与编程:** Python, R, Excel, Microsoft Office Suite, Matlab, C++, GUASS, Bloomberg Terminal

**个人能力:** 精通英语听说读写, 跨文化沟通, 极强的学习与适应能力, 独自解决突发问题, 积极主动的团队合作能力, 同时处理多项任务, 注重细节, 擅长分享展示对复杂问题的理解

**兴趣:** 钓鱼、徒步旅行、旅游、视频剪辑(必剪, PR)