

国泰君安证券衍生品投资部 线上宣讲会

2020年5月10日

目录



部门介绍



岗位类型



反馈沟通

1 部门介绍

证券衍生品投资部（自营）

部门业务介绍

权益类相关的所有品种，包括：股票、可转债、期指、期权、场外OTC等。

业务涉及：

- 股票、转债、基金等品种投资
- 期指方面的交易
- 场内期权、ETF等品种的做市商
- 场外业务的一级交易商
- 其他客需业务等

我部的认识：

- 1、规模体量大、团队氛围好、成长迅速
- 2、业务灵活多样、发展迅速、牌照优势
- 3、与国际大投行深入开展业务，扩宽自身视野
- 4、与国内顶级私募、公募、保险、信托、期子均有深入合作
- 5、类比看涨期权 vs 雪球期权（有风险）

2 岗位类型

衍生品Quant实习



- 场外期权定价：熟练掌握Monte Carlo模拟和PDE等定价方法
- 期权对冲研究：对于不同类型期权的对冲方面研究
- 波动率维度和相关性矩阵等估计和校准以及模型校准
- 新产品的结构设计和定价

量化交易策略实习



- 学习多因子策略的研究方法，利用各种金融数据分析工具（机器学习等），对大量数据进行研究
- 挖掘有效因子，通过因子有效性测试框架
- 辅助搭建多因子回测和业绩归因体系
- 熟悉机器学习、深度学习或强化学习等知识，用以量化交易策略开发

场内期权策略实习



- 场内期权投资策略研究和开发
- 计算场内期权的盈亏损益和风险归因
- 隐含波动率、历史波动率等预测模型的研究和开发

投递邮箱

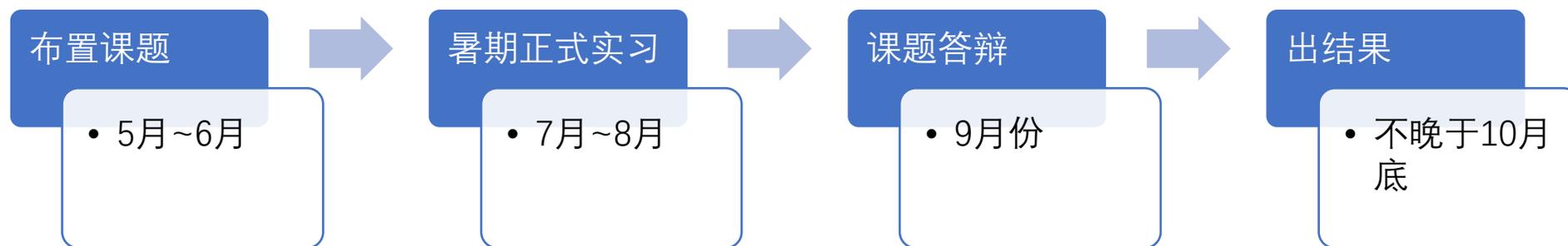
quant_intern2020@163.com

简历命名

学校简称-学历-专业-毕业时间-应聘岗位-姓名-实习天数

2 岗位类型

实习生招聘流程



Q&A

可能涉及的问题：

- 1、行业情况及部门业务等
- 2、岗位具体职责和所需技能等
- 3、流程方面问题等
- 4、其他问题

