



## 陈名礼 博士 CFA

michael.tan@aicapital.com

www.michaeltanphd.com

香港海怡半岛 27 座 6C 室

+852 62950210

### 简介

资管公司(AIC Capital)和自营交易公司(洪名)的创办人和投资总裁。研发并实现两家公司所有高频和量化投资策略。20 年余供职于国外顶级对冲基金，为大型机构投资者理财，经验涵盖交易、策略、技术、风控、营销、持牌等业务。深入了解另类资产资性能与配置，掌在管资金达 3 亿美元，运作统计套利、多/空股权、多因素模式、期货趋势跟踪和期权套利等投资策略。

### 成就

**创办人** 洪名科研有限公司 (Alluvium Global Research Limited) 香港 2012 至今

洪名信息技术咨询(上海)有限公司

**顾问** Snap Innovations Pte Ltd 新加坡

- 创建自营交易公司，开发中国股指、国债以及各种商品期货高频交易策略，实现高效C++算法、快速行情和高频专用硬件技术。
- 以合伙人自有资金为本运作多品种高频策略，从2014年中至今获利超 400%，期间仅一个月遭微小回撤，夏普比率在 6 至 20 以上。

**任事股东与投资总裁** AIC Capital LLC 纽约市 2009-2015

**董事与投资总裁** 奕源资金管理有限公司 (AIC Capital Asia Limited) 香港

- 创建资产管理企业，运作全球量化多/空股权策略，高峰期募集资金达9千万美元。
- 负责全部资管流程，包括策略设计、程序开发、交易监控、客户服务、风险分析、产品营销、牌照维护等业务。
- 开发本公司所有交易程序和后台系统，进行美、亚、欧股市和期市24小时的自动式交易。

**投资组合经理** Hite Capital Management (今 ISAM) 纽约市 2002-2009

- 根据以下投资策略，管理公司自有和客户资金达1亿9千万美元：
  - 全球股票均值回归
  - 盈利预测调整、伪造累积盈余揭露、价值和成长策略
  - 股指逆势和期权套利等模式
- 时刻与现有和潜在客户、外部基金经理沟通，检阅投资业绩、目标和分配。
- 以COMPUSTAT、CRSP、Starmine、Multex Fundamentals等大型数据库为基础，开发回溯测试和投资组合分析平台，运用技术包括 C#、Java、MATLAB 和 MySQL。
- 监督分析员与交易员团队，给基金和相关机构提供中后台支持。

**投资组合经理与研究主任 Graham Capital Management** 美国康涅狄格州 2000-2001, 1995-1997

- 创建并运作短线均值回归股票策略，募集达 3 亿美元资产。
- 研发全球宏观趋势跟踪策略、回溯测试与风险管理平台，并培训新博士级分析员，在该公司 1995 年初创时期，奠定研究部门基础。

**投资组合经理 Paloma Partners** 美国康涅狄格州 1999 - 2000

- 与纳西姆·塔勒布(即《黑天鹅效应》(The Black Swan)作者Nassim Taleb)共同管理全球股权、货币和债券期权量化策略，并为该公司开发期权套期保值和风险管理程序。

**数量金融分析师 Banque Paribas** 纽约市 1997 - 1998

- 研发美国国债收益率曲线利差套利策略，为公司 1998 年取得 40 万美元的收益。

**物理学家 Cambridge Hydrodynamics Inc** 美国新泽西州 1994 - 1995

- 首用大规模分子动力学模拟方式，研究颗粒体力学奥秘，发表过 10 篇经审阅的科学论文。
- 获得美国政府 75 万美元研究资助，进行颗粒流的计算技术和统计力学研究。

## 教育背景

美国普林斯顿大学 (Princeton University) 博士 (1995) 硕士(1992) 应用与计算数学

美国阿默斯特学院 (Amherst College) 学士 (1990) 物理 (一等荣誉学位)

英国剑桥大学 (Cambridge University) (1989) 进修物理和数学

CFA 特许资格认证

美国证券交易商协会系列 3 牌照

香港证监会 9 号 (资产管理) 牌照

[www.michaeltanphd.com](http://www.michaeltanphd.com) 网站上有本人发表过的学术论文

新加坡公民、香港与美国永久居民