



## 教育经历

- 香港理工大学 (QS 65) 2022.09 - 2024.03  
数据科学与分析 Data Science & Analysis 硕士 ; GPA: 3.7/4
- 南开大学 2018.09 - 2022.06  
计算机科学与技术 & 金融学 (双学士) 本科
- 计算机: 平均学分绩: 85.1 / 100, GPA: 3.5/4. 金融: 平均学分绩: 80.65 / 100, GPA: 3.0/4.
  - 奖项: 2018-2019学年公能奖学金, “校长杯”创新创业大赛校级优秀奖。

## 实习/项目经历

- 长城证券股份有限公司 | 研究院策略组 | 实习生 | 上海 2022.12 - 至今  
跟随组内导师进行国内政策分析、行业分析、国际战略分析, 独立实现部分量化策略并回测, 主动提出自己的优化方案, 为导师提供 A/B test。所实现策略预计将进行实盘, 个人期间表现获得导师好评。
- 分析报告: 中央经济工作会议报告分析; 消费行业研究分析; 中美能源战略分析。
  - 量化策略: 实现三年次新因子选股策略 (提议尝试Markowitz权重, 但结果并未明显改善因此未采用; 通过回撤控制将年波动降至21%, 年化收益约21.88%, sharpe约1.018); 实现稳健成长选股策略 (和导师尝试不同选股因子, 未加入trailing stoploss年化收益约21.75%, sharpe约0.66); 行业轮动因子挖掘并维护周报; 在JoinQuant回测系统实现策略, 熟练运用相关api。期间均使用Wind、iFinD、JoinQuant等数据接口, 能熟练获取各类数据。
- 前海维港创业投资基金 | 行研 | 实习组员 | 深圳 2020.08  
实现潜力企业筛选, 模拟IPO路演。本小组成功完成了既定目标, 获得了导师的好评。
- 合理分析某影视器材租赁公司BP, 完成teaser撰写, 详细分析了为什么需要融资、怎么融资、如何运用融得资金的问题。
  - 利用PEST、波特五力框架对影视器材租赁行业、特效制作进行行业分析, 利用SWOT框架对该公司进行尽调分析, 并撰写报告。
  - 代表小组完成模拟IPO路演与答辩。
- 投资组合管理 | 组长、组员 | 5次优秀作业奖 2021.09 - 2022.01  
利用理论知识对现有基金投资组合进行分析, 并合理评判基金经理对资产的动态调整能力, 最终构建自己的国际投资组合。最终获得7次作业中的5次优秀作业奖, 课程得分96。
- 验证QDII基金国际投资组合构建标准, 发现仅有58.82%的基金调仓行为符合低相关性原则。
  - 择股能力分析: 实现蒙特卡罗模拟, 画出资产组合有效边界, 寻得最优风险组合; 利用解析解求得最优风险组合。
  - 择时与调整能力分析: Alpha和Beta行为分析, 利用TM模型分析择时能力。
- 期间积极调动组内成员讨论, 商讨项目实现方案与分工, 完成数据分析和可视化工作。
- 固定收益证券 | 组长、组员 | 优秀作业 2021.09 - 2022.01  
寻找相似历史节点, 实现基于历史加息事件下收益率曲线变动对其当期变动的预测。
- 收益率曲线计算: Bootstrapping、样条法、插值法
  - 收益率曲线形态分析: 直观分析、PCA分解分析
- 正确预测了收益率曲线形态从加息预期出现前的上升, 到加息预期出现的驼峰以及加息之后的倒挂形态。

## 毕业论文

- 基于金融舆情分析的资产价格预测研究 (计算机本科毕设) 2022.01 - 2022.06
- 通过Scrapy框架爬取90万条股吧评论, 利用针对金融领域预训练模型FinBert对评论计算情感向量, 修正RNN预测结果。结果显示该因子提升了GRU网络预测精度, 且能在市场舆论情绪有较大的变化的时候捕捉到突变信号, 从而获得短期波动收益。
- 基于机器学习的股票配对交易策略研究 (金融学本科毕设) 2022.01 - 2022.06
- 利用PCA进行特征降维, 并利用OPTICS算法进行相似资产聚类, 从而大幅收窄配对资产搜索空间; 利用协整法确认配对资产; 对比分析不同交易策略, 并证明基于GRU的预测模型有较好表现。

## 社团和组织经历

- 南开大学计算机学院学生会 | 干事、羽毛球院队队长 | 被评为优秀干事 2018.08 - 2019.05
- 组织学院羽毛球队训练, 教授相关技巧。负责本学院有关体育比赛事项的预热宣传及现场报道、比赛队伍的组建以及陪同、后勤物资的准备与调配、微信公众号运营等。获南开大学羽毛球新生杯亚军; 获南开大学羽毛球校长杯团体亚军两次, 四强一次。
- 其他活动 | 队长、意见反对者、优化方案提出者
- 参加美赛获S奖; 参加“行走天津”城市挑战赛, 期间完成0元生存挑战, 对最初方案提出了异议, 并和队员合理沟通, 提出了更为高效和透明的公益资金募集方式、建立公益监督机制, 资金募集效率提高两倍以上, 最终将余款300多元捐赠给公益项目。

## 个人总结

- 英语: CET-4、CET-6; Duolingo 110。
- 技术:
  - 熟悉: Python、C/C++; Pytorch、CNN、RNN; SQL; Git; Office; Wind、iFinD、JoinQuant
  - 掌握: NLP; NoSQL; 时间序列分析
- 有较强的学习能力, 负有责任心, 能及时发现问题提出异议, 作为督促者较好地推动团队分工合作, 为团队增产增效。