

张治琛

北京市海淀区颐和园路 5 号北京大学 (地址)
100871 (邮编)

15810028083 (电话)
zhangzc@pku.edu.cn (邮件)
github.com/jasonzhang2333 (GitHub)



教育经历

- **北京大学** 国家发展研究院 · 金融学 2016.09 – 2019.06 硕士学位
– 高级计量经济学 (91), 高级宏观经济学 (91), 高级微观经济学 (84), 数理经济学 (89), 量化投资策略 (93) 等
- **北京航空航天大学** 软件学院 · 软件工程 2009.09 – 2013.06 学士学位
– 数据结构与算法, 计算机组成原理, 操作系统, 计算机网络, 数据库系统原理, 编译原理, 离散数学等

技能专长

- **语言:** Python, C/C++, R, C#, MATLAB, SQL, LaTeX
- **项目/框架:** NumPy, pandas, scikit-learn, PyTorch
- **数学:** 数理能力较强, 高考数学 146/150, 考研数学 149/150

实习经历

- **嘉实基金** 投资顾问部-债券/量化实习生 2018.06 – 2018.09
– 通过 RBF-SVM 算法对嘉实智能投顾系统的客户进行画像分析, 对客户申购赎回行为进行统计学分析
– 通过 OLS-post LASSO 算法对宏观变量进行特征过滤, 开发出宏观动量策略, 样本外年化超额收益 18.52%
– 研究利率债市场, 共阅读 13 本宏观、固收类书籍, 与 4 位基金经理深入交流, 撰写 7 期《嘉实投顾债市动态报告》, 对利率债市场未来走势从基本面、去杠杆、去产能、地方政府专项债、资金面等多个方面进行分析
- **嘉实资本** 金融交易部-量化实习生 2018.01 – 2018.06
– 参与完成底层基于ICE远程回调框架的高频交易系统
– 参与完成基于 QTS 实时行情接口和 mmap 的行情数据收发存储子系统
– 参与完成基于QuickFIX和PostgreSQL的交易下单子系统
– 参与完成基于DevExpress和PostgreSQL的交易风控子系统
- **灵均投资** 金融交易部-量化实习生 2017.10 – 2018.01
– 对十年 Level-2 行情数据进行整理、清洗、合并与统计分析
– 对日内交易特征进行统计学分析, 开发出隔日动量量化策略, 无影线阳线隔日小幅度波动开盘, 买入具有显著正回报, 样本外夏普比达到 1.1
- **天弘基金** 金融产品部-量化实习生 2017.08 – 2017.10
– 对二八平衡、二八轮动、行业优选策略进行量化分析, 根据买卖分析改进智能定投策略, 策略波动显著降低
– 研究了遗传算法、随机森林等机器学习算法在多因子模型中的应用
- **径点科技** 软件研发部-软件开发工程师 2013.07 – 2015.09
– 从事公司核心企业级软件产品的数据处理引擎模块的开发
– 参与完成 Office 文件解析、数据正则匹配、社交平台流数据抓取子模块开发, 领导本地文件处理组件的开发

获奖情况

- **第十五届中国研究生数学建模竞赛** 一等奖 2018.09
- **2016–2017 学年北京大学三好学生** 2017.12
- **“量子杯”全国高校量化投资策略设计大赛** 第三名 2017.10
- **第二十二届“冯如杯”学生学术科技作品竞赛** 二等奖 2012.05