



岗位：

量化工程师（量化研究员）、数据挖掘工程师、机器学习工程师

● 技术能力：

Python 语言基础扎实，有良好的编码习惯

算法工具类：

## 机器学习

- 熟练掌握机器学习算法，
- 监督学习：如分类 K-近邻算法、逻辑回归、朴素贝叶斯、决策树、随机森林，  
回归算法：线性回归、岭回归
- 非监督学习：k-means 算法
- 掌握 numpy、pandas、matplotlib、scikit-learn 等常用数据挖掘、机器学习算法工具；
- 掌握 KNN、朴素贝叶斯、逻辑回归、决策树、随机森林等基本分类算法；
- 掌握线性回归等回归算法，k-means 聚类算法等；
- 熟练掌握数据清洗、模型建立、训练、参数调优流程。

## 量化交易

- 了解金融市场基础知识
- 熟练掌握 Alpha 策略开发，以及策略开发流程
- 熟悉各类策略的衡量指标
- 掌握多因子模型的常用技术，IC 分析、收益率分析以及因子相关性
- 掌握股票数据的处理技巧，去极值、标准化以及中性化
- 掌握 Alphalens 本地因子分析工具使用
- 掌握量化交易策略设计、评估及优化工作
- 具有较强的金融基础知识和数据处理分析能力
- 熟练阅读各大证券公司研究报告，并进行分析生成策略
- 熟悉机器学习 Sklearn 框架下开发策略，调优参数，特征提取等相关编程工作。

## 深度学习

- 掌握神经网络基本原理，例如卷积神经网络以及常见模型 AlexNet、GoogleNet
- 熟练掌握 TensorFlow 框架使用以及神经网络模型搭建流程。



#### 工作描述

- 基于 A 股市场上市公司基本面数据、盈利预测数据和行情数据等进行多因子量化选股策略研究，已完善多套量化策略，并实盘跟踪交易；
- 基于 Python+Wind 架构的轻量级量化策略回测平台，因子和上市公司事件数据不定期维护；

#### 工作描述

- 研究量化模型 研究传统多因子选股模型，探究人工智能算法在多因子选股中的应用 研究期权合成现货模型 基于陆股通股票成交情况，研究陆股通策略
- 负责量化对冲业务线的交易任务 具有量化对冲交易的实盘经验，包括股票组合、股指期货的交易经验 量化对冲的策略主要有两种：行业中性 Alpha 策略和基差套利策略。量化对冲业务线实盘交易年化收益 7.2%，今年以来的年化收益 9%

#### 工作描述

- 1、开发 Alpha 策略、CTA 策略、基本面量化多头策略等，不断优化策略表现，提高夏普比率。

#### 工作描述

- 1、研究股票多因子选股模型，研究内容主要包括因子库构建，单因子有效性测算与筛选，非线性因子处理，相关性研究，多因子选股模型回测与模拟盘搭建，控制策略波动率，统计并定期汇报模拟盘净值相关情况。
- 2、商品期货策略相关的交易工作，撰写交易日志，整理每日影响商品走势的重大新闻。
- 3、核算已发行产品各策略的每日净值；
- 4、股票数据库搭建与维护工作；其他策略辅助研究（如日内投机策略）；

#### 工作描述



- 1.量化选股、对冲策略研究与开发（Python），包括基本面选股、衍生品对冲、行业对冲、融券对冲等不同对冲策略的研究与回测。验证成长因子策略，回测只做多、完全对冲、择时对冲等几种对冲方式下的收益。

#### 工作描述

- 1. 负责量化策略的开发与回测。
- 2. 负责数据库维护。

#### 工作描述

- 负责交易策略开发，优化，实施和监控，开发策略涉及多因子选股

#### 工作描述

- 阅读市场中关于量化交易的研究报告与学术论文，包含中低频策略以及高频交易策略；

#### 工作描述

- 开发基于机器学习的股票多因子模型，并定期跟踪维护模型；
- 使用 Python 搭建量化回测框架，并进行因子有效性测试，完成因子评估模型；

#### 工作描述：

- 参与设计因子量化平台架构设计，独立开发因子计算任务调度模块；IC、IR、等指标因子的量化程序开发；。
  - 实盘管理 ■ 17年8月至今，以多因子策略独立管理股票对冲产品1200万，累计收益率8.84%，年化收益率17.68%，最大回撤2.84% 对策略进行不断迭代，近三年回测业绩为年化收益率22.6%，信息比率3.2
  - 每日监控策略运行，编制策略业绩报告和归因分析报告，与部门总监交流策略和行情想法
- #### 策略开发
- 独立编写因子筛选、组合优化、业绩回测、参数寻优、开发新的因子，目前程序稳定性较高
  - 维护数据库，Wind、的API，编写数据自动更新模块



- 
- 根据 Barra 搭建完整风险模型，测试因子有效性，通过 IR 最优化生成组合权重并加以回测
- 使用 Python 搭建回测框架；研究并改进米筐公司的 Rqalpha 包

#### 工作描述

- 基于多因子模型的 alpha 分解构建多因子模型。尝试从两个方向进行突破，算法和因子
- 数据库与爬虫服务器。为多因子模型服务，一键式的易于维护的爬虫系统，负责从常用的数据获取源更新数据到数据库，方便模型操作。

#### 工作描述

- 计算投资组合的每日投资损益，计算夏普比率，信息比率，最大回撤等风险系数，以及绩效归因（Brinson Attribution）等投资组合绩效评价指标，并进行可视化展示
- 对投资组合中各个股票做主成分分析（PCA），获取影响投资组合风险的主要因子
- 数据挖掘：负责数据挖掘、清洗处理，数据统计分析 多因子策略：基于基本面（PE、EPS 等）、技术面等指标，结合主成分分析技术，寻找阿尔法收益

#### 工作描述

- 1.根据公司股票研究部门提出的策略回测需求进行量化回测程序的设计、开发
- 2.生成回测报告主要参考：夏普比率、成功率、年化收益及盈亏比等指标。
- 3.在米筐、聚宽平台开发波动率、缠论顶底分型+换手率（针对次新股）等量化选股策略及实盘预警
- 4.编写爬虫程序在同花顺、东方财富通等网站爬取沪深 A 股大、中、小单净流入资金数据的。
- 使用米筐客户端 基于机器学习的量化投资策略开发，Python
- 量化开发：



- 2、管理股债恒定比例策略组，负责线上实盘调仓及复盘工作；
- 3、协助搭建量化策略的回测平台、参与平台基金评分项目；
- 4、负责部门全部量化策略程序上线流程及线上 Linux 服务器的日常维护工作。
- 5、寻找总结国内外优秀量化策略（Barra 多因子、风险平价等）并研究如何优化使其符合国内市场。