



林雅琪

國立政治大學金融所財務工程組



03-5999382



<https://github.com/AkiLin7110>



0976011371



akilin7110@gmail.com



新竹縣湖口鄉德盛村28鄰明豐路12巷18號

教育背景

- 碩士：2022.09 - 2024.06
 - 國立政治大學金融所財務工程組
- 學士：2018.09 - 2022.06
 - 國立清華大學計量財務金融學系
 - 國立中山大學財務管理學系(轉學至清華大學)
 - 國立中山大學政治經濟學系(轉系至財務管理學系)
 - 書卷獎(1/50)

專案經歷

- 資產配置
 - 類股輪動
 - 美國市場
 - 運用美國國債與公司債之利差，判斷景氣循環走向，獲得優於大盤(SPY)之績效
 - 臺灣市場
 - 採用PCA及相對價值之估計，判斷產業之景氣，獲得優於大盤之績效
 - 市場風向標
 - 運用技術指標與報酬率之相關係數調整最適參數、失業率、零售銷售、工業生產等投票權，每月進行多數決，作為股債間選擇之依據
 - 獲得優於大盤之績效
 - 轉化尾部風險
(<https://gammaparadigm.com/2023/03/07/the-application-of-turning-tail-risks-into-tailwinds/>)
 - 實作論文，運用不同種類之風險評估方式，使用Correlated Risk-Parity組成資產配置，使其不會因風險大小評估重壓同一種資產
 - 獲得優於大盤之績效
- 交易策略
 - 配對交易：最大概似估計法估計配對交易訊號與分位數訊號之績效表現比較
 - CTA：
 - Time/ Price Scale-In Strategy (TPS) 採用RSI技術指標，確認市場趨勢，分批進場
 - Momentum：運用今日收盤前30分K及今日開盤30分K，作為投資人消化市場資訊之訊號
 - 處置股
 - 過證交所及櫃買中心所公告之注意資訊找到套利機會，同時發現當其符合一定資格後，有高達9成之機率會被關緊閉，其處置期間漲幅相對於處置前之漲幅也明顯下降
- 文字探勘
 - 運用PTT股板評估與大盤之間之連動性

工作經歷

- **實習生** 元大證券股份有限公司計量交易部 2023.09 - 2024.01
 - 處置股之交易策略
 - 市場微結構研究
 - 採用Cypher及Python 建置資料庫
- **實習生** 凱基證券股份有限公司債券部 2023.07 - 2023.08
 - 從LIBOR到SOFR的風險分析
 - 同業分析
- **實習生** 高曼計量財務管理顧問股份有限公司 2022.08 - 2023.07
 - 研究多元資產配置組合
 - 實作論文及其改善方法
- **實習生** 元大證券股份有限公司金融交易部 2022.02 - 2022.06
 - 將公司內部資料串接Webex的Chatbot
 - 研究國外論文以利開發交易策略
 - 量化文字，藉此預測股價波動

社團經歷

- **成員** TMBA 2022.09 - 2023.08
 - 程式交易部：取得Bincentive量化競賽第一名
 - 國際金融展望部：分析印度新興市場
- **活動長** 國立清華大學轉學生聯誼會 2020.09 - 2021.06
 - 與校方合作，舉辦超過百人的活動
 - 擔任許多場迎新活動主持人及司儀
- **公關長** 國立中山大學北友會 2019.02 - 2020.07
 - 擔任社團對外聯絡窗口
 - 協辦跨友會聯合迎新
- **隊員** 國立中山大學桌球校隊 2018.06 - 2020.02
 - 2019全國大專院校桌球第六名
- **夜教長** 國立中山大學政治經濟學系宿營 2018.09 - 2019.07
 - 突破舒適圈，擔任領導者

自傳

#個性積極 #抗壓性佳 #危機處理 #細心負責

求學經歷與社團經驗方面，我大一就讀於國立中山大學政治經濟學系，修習財務管理學系所開設的管理學後，發現自己對於財管系課程的興趣更加濃烈，因而大二轉系至財管系。在修習資工系開設的程式設計後，發現想要將程式與金融作結合的熱情，因此毅然決然轉學至清大計財。就讀中山大學期間，除了在政經系拿到書卷獎第一名，在課餘時間，修習德文課程、參加桌球校隊獲得大專盃南區錦標賽第六名、擔任北友會公關長負責對外聯絡窗口、擔任宿營夜教長等角色，不斷突破角色與社交上的舒適圈，讓我在面對壓力時，仍然能夠怡然自得。就讀清大時，擔任轉學生聯誼會活動長的角色，主辦與校方合作的暑轉說明會，第一次擔任總召與校方合作舉辦暑轉說明會，舉辦參與人數破百的活動，因為疫情專案，有許多來自國外的轉學生，突破原先預定的場地人數上限，緊急向校方提出場地申請並成功獲得許可，讓我知曉要如何因應突發狀況，並擔任迎新活動的主持人。除此以外，在設計處置股交易策略時，由於細心地檢查回測資料，發現法規改制即時反應至公司之示警系統。