

# 向泉州

(+86) 18019105825 | xiangquanzhou@fudan.edu.cn



## 学历背景

### 复旦大学大数据学院

中国, 上海

理学硕士, 统计学专业, 统计机器学习方向 (保送) 导师: 江如俊

2022.09-2026.06 (预计)

- 课程: 高等统计学习, 最优化理论, 神经网络与深度学习, 大数据与金融风险管理

### 复旦大学经济学院

中国, 上海

经济学学士, 国际经济与贸易专业

2018.09-2022.06

- 课程: 统计学, 计量经济学, 线性代数, 概率论与数理统计, 博弈论, 宏观经济学, Python 程序设计

荣誉: 华为奖学金 (5%)、戚克梅奖学金 (本科仅一位)、优秀学业奖学金、复旦大学优秀毕业生 (10%)

## 论文/项目经历

### RSAP-DFM: Regime-Shifting Adaptive Posterior Dynamic Factor Model for Stock Returns Prediction 中国, 上海

IJCAI (人工智能顶会) 已接收, 第一作者; 在 A 股市场回测中达到最先进 (SOTA) 性能 2023.08-2024.04

- 提出了一种名为 RSAP-DFM 的股票收益深度学习预测框架, 该框架摒弃了人为因子构建过程, 通过先验-后验学习极大提高了 DFM 的鲁棒性。据我们所知, 我们首创提出基于梯度的后验因子, 构建了双层优化形式

### DAST: A Double Adversarial Strategy with Sum of Top-K Loss for Credit Card Fraud Detection 中国, 上海

汇丰银行合作项目; 产出两篇学术论文已被 IHMSC 2023 与 ICDSCA 2023 录用并已申请专利 2022.12-2023.05

- 提出了一种名为 DAST 的新金融欺诈识别架构, 结合负校准 GAN 过采样方法、对抗性学习和 top-K 损失

## 实习经历

### GF Fund Management 广发基金

中国, 上海

固定收益研究部 固收量化方向实习生

2024.07—2024.09

- 基于净值数据改进 Campisi 方法, 实现纯债基金高频业绩归因; 系统性探究水平、凸度、信用等多因子回归偏离程度, 回测分析调仓断点; 全面分析纯债基金二季报并深入数据分析, 研究绩优纯债基金的超额收益来源
- 开发全新日频断点识别策略, 分析特定纯债基金及全市场的久期等因子变动, 判断策略变化及债券市场趋势

### Aegon-Industrial Fund 兴证全球基金

中国, 上海

FOF 投资与金融工程部 实习生

2024.04—2024.06

- 基于 MVO、VaR、Black-Litterman 等模型完成多类底层资产配置与国内股债配置回测比较, 通过随机森林算法预测非平衡可转债数据的下修事件概率并分析变量贡献度, 探究单资产与多资产波动率与最大回撤关系
- 探究中美股权溢价预测策略, 并基于预测组合方法和机器学习方法构建股债配置投资决策; 将预测作为专家观点纳入优化, 构建五类大类资产配置策略, 年化收益率达到 12.55%, 遥遥领先于传统配置策略

### INDUSTRIAL SECURITIES 兴业证券

中国, 上海

经济与金融研究院 金融工程组 实习生 (2023 年新财富第一名团队)

2023.11-2024.03

- 撰写深度报告一篇, 提出全新角度寻找调研行为模式信息潜藏的 alpha, 具有强可解释性, 在不利用其他增量数据的情况下最高达到 37% 的年化收益率, 保证个股数量的情况下年化超过 32%, 每年稳定胜过基准指数
- 基于 Barra 因子体系对各大指数 2023 年持仓与月频收益进行分解, 观察不同业绩表现下的因子驱动; 编制中证沪港深龙头指数, 完成不同版本的测算与更新; 计算北向资金相对沪深 300 指数的行业偏离情况
- 基于正则表达式完成全 A 海外营收占比提取, 开发基于产能和库存情况行业轮动策略, 以及客户的其他课题

### CHINA SECURITIES 中信建投证券

中国, 上海

华东三部 投资银行部 实习生

2022.02-2022.06

- 深度参与某化工企业科创板 IPO 项目 (已上市), 对发行人资产进行抽凭核查及盘点, 完成公司财务流水以及流水核查, 协助荣达完成穿行和截止性测试, 重点参与法律部分底稿文件制作, 涉及股权穿透、合规证明等
- 收集材料并撰写招股说明书财务部分章节初稿, 参与项目财务底稿整理并协助完成验收, 同比上市公司业务与技术数据收集, 协助完成收入确认、成本核算等内容, 独立完成上会 pitchbook, 并进行会议纪要撰写工作

## 学生工作

### 复旦大学经济学院 学生会执行主席

2021.03-2022.03

- 建立院系之间与校院之间的两级联动体系, 统筹协调各部门完成 20+ 项大型活动, 服务经济学院全院师生

## 技能兴趣

奖项: 华泰证券 Fintech 创新挑战赛一等奖、九坤量化联赛股票模拟交易赛初赛第四名

技能: 熟练使用 Python(Numpy/Pandas/Pytorch)、Microsoft Office、Stata, 熟悉 Linux 开发环境

活动: 复旦大学学生常任代表、院系杯足球赛助攻王