



杨睿

✉ yangruipis@163.com 📝 cnblogs.com/yangruiGB2312
☎ (+86) 188-1823-1378 🌐 github.com/Yangruipis
🏠 上海市-松江区-文汇路 600 弄

🎓 教育经历

上海对外经贸大学 2012.09 – 2019.03
研究生 (保研) 数量经济学 专业排名:4/17
本科 统计学 (商务统计方向) GPA:3.31, 专业排名:2/54

🏆 荣誉和奖项

“华为杯”全国研究生数学建模大赛 二等奖 (top 15%) 2017.09
中国大数据创新行动大赛 一等奖 (top 1, 奖金 5 万元) 2016.12
“东证期货杯”统计建模大赛 一等奖, top 10 in 1000+ 2018.03
美国大学生数学建模竞赛 (ICM) 二等奖 2016.02
上海市优秀毕业生、校十佳学术标兵、爱建企业奖学金一等奖 (全校 top10)

💼 工作经历

上海通金投资有限公司 (通联数据旗下私募), 量化研究员 2017.04 – 2017.10

- 基于机器学习的期权策略, 包括了 50etf 期权相关特征提取, 模型选择等 (LR, SVM, LSTM), 策略回测收益 12%
- CTP 接口 Python 版本再封装与测试, 大大简化了策略模拟盘和实盘操作 🌐 ctp-python
- 股指期货跨期套利策略模拟盘与实盘上线 (python)

Kantar Media CIC (中国领先的网络口碑咨询公司), 数据挖掘 2016.03 – 2016.10

- 文本挖掘软件开发 (两个月, C#), 包括了窗体设计和优化、情感分析 (Naive Bayes, word2vec), 文本匹配 (根据公司业务场景提出规则表达式方法)
- 爬虫 (BS4, WireShark 等); 数据可视化 (ggplot2, ggmap); 微博账号影响力评价体系构建

📁 项目经历

Kaggle Home Credit Default Risk 2018.06 – 2018.08


- 负责特征工程, 包括了数据预处理, 多表聚合, 特征选择 (Lasso, LightGBM, FeatureTools), 以及模型的选择和优化 (GridSearch, BayesOpt, LightGBM, Stacking)
- 截至 2018 年 7 月 5 日, 获得 AUC 值为 0.798, 在 4500+ 队伍中排名 16%

“东证期货杯”全国大学生统计建模大赛, 信贷违约模型 2018.01 – 2018.02

- 负责利用 python 实现完整机器学习流程, 包括数据入库、特征工程、模型选择 (LR, NB, CART, RF, GBDT)、模型调参 (bayes 优化) 与融合 (Stacking), 获全国一等奖 (top 10 in 1000+)
- 难点 1. 数据不平衡 (SMOTE+Tomek); 难点 2. 需要降低授信成本 (引入 Cost-Sensitive Matrix)

个人机器学习库开发 2017.12 – 2018.01

- 个人项目 🌐 simple_ml, 开发语言: python, 开发平台: Manjaro, 开发工具: Emacs+PyCharm
- 仅依赖 numpy 实现了常用的特征工程、模型评价、分类 (LR, KNN, NB, DT, SVM, SVR, BP, AdaBoost, GBDT, RF, stacking) 与聚类 (K-means, 层次) 算法、自动化数据预处理和特征选择方法, 测试覆盖率 43%

- 团队项目  VISAP，开发语言：C#，开发平台：Visual Studio
- 负责统计功能 (空间作图、方差分析、回归分析、时间序列、灰色预测等)，抽样算法开发 (ARS)
- 爬虫对接，包括：国家统计局宏观数据、财经股票数据等一键获取；界面开发和优化

技能 & 自我描述

- python 三年开发与建模经验，熟练使用 *sklearn, pandas* 等库，熟悉 *XGBoost, LightGBM, TensorFlow, Keras*, 面向对象编程
- 熟练掌握 *MySQL, Hive* 的查询和优化、*R* 语言数据可视化，*Java* 实现基本数据结构与算法，了解 *Git, Spark, Docker*，两年 *Linux* 使用经验，长期使用 *Emacs* 和番茄工作法进行 *GTD*。
- 数理统计基础扎实，熟悉计量经济，多元统计，时间序列，贝叶斯统计等方面的知识。
- 熟练掌握机器学习相关算法及原理 (*SVM, LR, DT, RF, NB, GBDT* 等)，了解深度学和推荐系统基本算法 (*RNN, LSTM, SVD, ICF* 等)

热爱数据与编程，有大量统计建模经验，喜欢从底层实现算法。乐于挑战，追求新技术。英语读写流畅 (CET6:541)，爱好有摄影（校摄影大赛二等奖）、骑行 (270km/3 天) 等。