

卢昱鹏

90 St. Mary's St, #5-2, Boston, MA | +1 617-838-1182 | ypl@bu.edu | [LinkedIn](#) | [GitHub](#)

技能/证书及其它

编程: Python, Pytorch, Docker, Django, C, C++, R, SQL, LaTeX, C#(自学中)

数学: 计算数学, 随机微积分, 测度论, 统计学, 微分方程和偏微分方程, 线性代数, 概率论, 高等数学

证书: Bloomberg Market Concepts(BMC)

教育经历

美国波士顿大学 **金融数学和金融科技** **硕士** 预计 2022 年 12 月毕业

- GPA 3.98/4.0, \$1,5000 入学奖学金
- 课程: 编程和数学(Python, SQL), 统计学(R), 金融数学编程(Python, C++), 随机过程在资产定价中的应用, 金融学, 进阶机器学习(Python), 固定收益证券定价(Python), 金融数学计算方法(Python), 神经网络和深度学习(Python, Docker, Linux)

美国俄亥俄州立大学 **物理学** **本科** 毕业于 2021 年 7 月

- GPA 3.84/4.0, \$2500 学术奖学金, \$4000 学术奖学金
- 课程: 微分方程和偏微分方程, 计算物理(C++, Linux), 分析力学(Python), 经典力学 I&II(Mathematica), 实验物理(MATLAB), 量子力学, 电动力学, 工程学(MATLAB, Excel), Python 基础, 利息理论, 微观经济学, 宏观经济学, 热力学, 流体力学, 工程力学, 机械工程, 机械设计

实习经历

远程软件工程实习 2022 年 3 月-现在(工作时间不固定)

- 在 The City Tutors 软件开发团队改进完善该公司网站开发。
- 主要使用 Django 和 MySQL 丰富网页内容, 用于相关 K-12 教育辅导老师申请匹配等操作。

中银保险 **数据处理实习** 2021 年 6 月-2021 年 8 月

- 使用 SQL 对公司产品进行分类提取, 导出 Excel 文件。
- 用 GLM 模型计算派息率, 调整现有模型的风险因素来为产品定价。

华夏基金 **投资研究实习** 2020 年 10 月-2021 年 1 月

- 收集并处理 A 股股票价格, ARIMA 模型预测 100 只股票未来股价并根据模型构建投资组合, 回测。
- 使用 LSTM, 神经网络等机器学习模型训练数据, 测试模型。

光大证券 **定价策略实习** 2020 年 5 月-2020 年 8 月

- 进行可转换债券定价研究项目, 应用蒙特卡罗模拟对债券进行估值
- 敏感性分析和 Cox-Ross-Rubinstein 期权定价模型评估模型。

浩天信和律师事务所 **商务助理实习** 2019 年 6 月-2019 年 8 月

- 参与国有企业并购及资产评估, 与审计事务所进行资产核查和处置, 审核会计账目中应收应付的经济活动。

项目经历

大数据分析 2022 年 4 月-现在

- 下载币安 20G 的交易数据集, 清洗数据, 设计数据库并用 SQL 提取信息和计算
- 使用 spark RDD 和 Hadoop 相关大数据计算框架优化并在 docker 容器中运行

2022 年 IAQF 竞赛(预测市场状态) 2022 年 1 月-2022 年 2 月

- 使用隐马尔可夫模型, 神经网络, 卡尔曼滤波等机器学习模型预测市场状态(牛市, 熊市, 震荡)。
- 测试模型并根据模型所预测结果构建投资组合, 把所得收益率和买入并持有 3 年的收益率对比评估模型。

多因子投资模型 2021 年 10 月-2021 年 12 月

- 从 Bloomberg terminal 收集数据并进行数据处理, 清洗。
- 采用 WLS、IC 测试、单调性检验、多重共线性测试等方法对经过过滤的因子进行测试。
- 使用 OLS 和 ARIMA 得到预测的 beta 值, 通过分配股票权重, 在有限的风险范围内优化投资组合回报。

补充信息

语言: 普通话, 英语 GRE 330 (数学 168, 语言 162)

活动: 2019 年世界园艺博览会志愿者, 英雄联盟 2018 世界赛志愿者等, 新东方助教, 学生会宣传文编

兴趣: 羽毛球, 游泳, 健身, 旅行, 志愿活动