

## 李松浩

联系方式：130-9708-9601(美东时区) | 邮箱：[songhao@mit.edu](mailto:songhao@mit.edu)

### 教育背景

#### 麻省理工学院

美国马塞诸塞州，剑桥市

##### 金融硕士

2020.7 至今

- 平均绩点 (GPA) : 4.8/5.0
- 专业方向：金融工程；预期毕业：2021 年 12 月
- 主要课程：高级金融分析学，金融市场与资产管理，高级金融数学，算法设计，机器学习，高级自然语言处理

#### 香港中文大学（深圳）

广东省，深圳市

##### 应用经济学学士

2016.9 – 2020.6

- 平均绩点 (GPA) : 3.8/4.0 （专业排名: 1/48）
- 主要课程：计量经济学，投资组合管理，微积分，概率统计，最优化，C++
- 社团活动：学勤书院足球队（队长），校级公益组织行政部部长，经济协会（创始合伙人，学术部部长）
- 学术交流：牛津大学交流学术项目，09/2018 至 06/2019；相关课程：金融衍生品高级数学模型（A+）高级宏观经济学（A），高级微观经济学分析（A）
- 荣誉奖项：校长嘉许优秀毕业生（同届共十人，占比 1%）；学业奖学金（多次共计人民币 25 万）

### 职业经历

#### 磐安资管 (PANAGORA ASSET MANAGEMENT)

美国马塞诸塞州，波士顿市

美国顶尖量化资产管理，资产规模 400 亿美元+

##### 实习量化研究员，股票市场

2021.6 – 2021.8

- 因子研究项目：公司游说 (lobbying) 对美国公司表现和股票收益的影响。独立完成网页爬虫、数据清洗、假设检验、因子构建和回测。在四因子基准模型上获得 4%超额收益，信息系数的 t 统计量 > 2.6
- 基于公司已有 NLP 模型，在日本股票构建 6 个情绪分析投资因子。在四因子基准模型上获得 6%超额收益，信息系数的 t 统计量 > 3.4
- 改进关于美国证券交易委员会 (SEC) 的爬虫程序，扩展并维护美国上市公司季度报表数据库

#### 麻省理工 – 富达资管联合研究项目(MIT – FIDELITY INVESTMENTS)

美国马塞诸塞州，波士顿市

##### 金融工程研究项目

2020.12 – 2021.2

- 带领 3 人 MIT 学生团队与富达投资解决方案团队共同研究：保险性质的投资组合管理策略
- 提出了由股票、固定收益、商品期货共同组成的投资组合管理策略，其可在不影响投资组合表现的情况下，严格控制最大回撤

#### 华泰证券研究所

广东省，深圳市

##### 实习金融工程研究员，期货市场

2019.9 – 2020.1

- 引入遗传规划算法（特征工程）在期货市场，挖掘出的因子夏普比率 > 2.25；在项目中主要负责数据管理和设计特用于模拟期货市场投资过程的执行函数。参与撰写华泰金工市场报告：遗传规划在 CTA 信号挖掘中的应用
- 搭建基于强化学习 (Reinforcement Learning) 的量化投资环境框架并应用了 A2C, PPO 两个算法。回测中样本外获得 23% 年化收益，夏普比率 > 1.6

#### 盛冠达资产投资有限公司（深圳对冲基金，资产规模 30 亿+）

广东省，深圳市

##### 实习量化研究员

2019.6 – 2019.8

- 研究并优化基差-动量投资策略，提升样本外夏普比率 30%
- 在国际一线期刊中收集、整理、并在中国市场中复现 5 个量化期货市场投资策略，对比不同市场中的表现

### 其他信息

- 计算机：熟练使用 Python, C++, R, SQL；有一定的 MATLAB, SAS, STATA 等统计软件能力
- 兴趣爱好：足球、篮球、钢琴
- 志愿服务：深圳义工联 40 小时工时，曾带领本科生团队支教湖南大湖口中学