

薛耕

29-21 Northern Blvd Queens, New York, NY 11101 • (86)15624952875 • Email: gx301@nyu.edu

EDUCATION

纽约大学

管理与系统 硕士

美国·纽约

9/2018-5/2020(expected)

- 总绩点：4.0/4.0

- 主要课程：Managing in a Global Economy (A), Quantitative Models for Decision (A), Enterprise Application Integration (A), Information Technology & Data (A), Financial Management (A), Project Management (A), Research Process & Methodology (A)

北京理工大学 (BIT)

信息管理与信息系统 学士

中国·北京

9/2014-6/2018

- 总绩点：3.45/4.0, 专业排名前 20%

- 获奖：一等奖学金 (5%; 2015), 二等奖学金 (15%; 四次, 2014-2018)

- 主要课程：数据结构 (93), 数据库 (85), 信息系统 (85), 电子商务 (97), 企业资源计划模拟 (90), 系统分析与设计 (88), 计算机模拟 (90), 管理数学 (89), 概率论 (87), 宏观经济学 (84), 市场营销 (90), 运作决策 (94), Python (95)

香港大学

- 主要课程：Financial Analysis, Marketing, Leadership, Business Writing

香港

3/2016

PROFESSIONAL EXPERIENCE

京东金融 (NASDAQ: JD)

中国·北京

量化投资研究实习生

1/2018-4/2018

- 每周 40 小时; 开发、回测交易模型并将回测结果可视化, 其中一份重要产出是将纽大金融数学系系主任 Macro Avellaneda 文献中的统计套利策略进行回测形成的报告, 该策略在中国股市上表现良好
- 以脱水研报的推荐股票形成基本面策略并每日进行追踪; 翻译外文文献并在 A 股上进行测试, 比如多因子模型 Barra Chinese Equity Model (CNE5); 使用 Python 和 Excel 构造新指标比如 Variance Ratio 和 VPIN
- 为复杂指标 Rolling Beta 以及 PB_ROE 的计算用 Django 框架编写了网页应用; 使用机器学习技巧 lasso regression 来预测猫眼电影票房, 最终发现票房与周内上映日有着显著相关关系

中国科学院软件研究所 (ISCAS)

中国·北京

金融数据分析实习生; 与长沙中泰证券合作

5/2016-1/2017

- 阅读了量化交易系统开源框架 vn.py 的源代码, 完善了其中的回测模块, 由 CTA 回测改动到投资组合回测, 最后该系统具备实时交易、账户管理、策略回测及风险管理的功能
- 使用 Python 编写了 8 个策略, 其中的缠论策略作为实际交易的参考指标已经投入应用
- 使用 Pandas 和 NumPy 完成了一个独立的回测程序用于测试投资组合回报, 使得该引擎可以进行多策略多标的回测, 并且具备图形化显示的功能

ACADEMIC EXPERIENCE

THE IMPACT OF TAKE-AWAY BUSINESS AND PLATFORM MERGER ON CUSTOMERS' TRAFFIC OF GROUP-BUYING PLATFORMS: A CASE STUDY OF MEITUAN DIANPING

9/2017-12/2017

- 用 Python 编写网络爬虫在大众点评网上爬取了从 10/1/2015 到 4/28/2017 的 140GB 的北京餐馆信息
- 用顾客倾向得分配对, 检验了三个月内餐馆的外卖业务对于消费者的影响, 并进行了健壮性检验
- 通过 STATA 断点回归, 分析了消费者的评论数据, 评估了 2015 年美团和点评合并后的平台表现

FACTORS AFFECTING THE USE OF ECOMMERCE CONSUMER CREDIT SERVICES: A STUDY OF ANT CHECK LATER

第一作者, 团队组长

10/2016-7/2017

- 总结了阿里巴巴推广蚂蚁花呗的 14 种措施; 参与设计了调查问卷; 收集以及预处理了 373 份问卷反馈
- 利用 Python 及 SPSS, 使用 PCA 以及分层回归方法, 检验了影响用户使用消费者信用服务的影响因素
- 总结出了三种影响因子 (Bonus, Quota, Scenario) 都积极且显著地影响用户粘度, 并给出了建议

EXTRACURRICULAR ACTIVITIES

演讲者, 参与者 AMCIS 学术会议, 美国·波士顿

8/2017

八强 “达济天下” 求职大赛 (8/400) 中国·北京

5/2017

- 通过辩论、群面、案例学习和决策设计等方式进行比赛; 赢得了正略管理咨询有限公司的实习机会

队长 北理工业余足球队 (23 位成员), 中国·北京

9/2014-10/2015

- 23 名成员的非特长生球队创始人及队长, 赢得了 14-15 赛季的季军 (3/32) 以及 “最佳新生球队” 奖杯

PUBLICATIONS

Factors Affecting Consumers' Acceptance of E-commerce Consumer Credit Service; International Journal of Information Management (SSCI 索引期刊); 二作 导师: 贾琳

3/2018

Research on Factors Affecting the Use of Ecommerce Consumer Credit Services: A Study of Ant Check Later, proceedings of AMCIS 2017 (会议论文); 一作

8/2017

KILLS & OTHERS

编程技能: Java/JavaScript/HTML5/CSS/SPSS/C/STATA/MATLAB/Python (擅长网络爬虫、数据分析及可视化、系统设计与开发、网页应用开发、机器学习; 请参考 GitHub: <https://github.com/EthanXue301>)

语言: 普通话, 英语 (TOEFL:100, GRE:320), 日语 (基础)