

王雷



+86-15004513389 774810189@qq.com lwang925@uwo.ca
www.linkedin.com/in/lei-wang-uwo/ https://github.com/LeiWangUog

教育背景

- 英国格拉斯哥大学, 金融学, 理学硕士 2023.9 - 2024.6
- 绩点: GPA 3.5
 - 主修课程: 企业融资, 财务管理, Matlab 金融工程, Python 机器学习, 实证资产定价, 金融衍生品定价
- 加拿大西安大略大学, 金融管理, 管理学学士 2018.9 - 2022.6
- 绩点: GPA 3.8,
 - 校内奖项: 2018-2021 三个年度校内奖学金, 2020 校内学术成绩优秀奖, 三次 Dean's Honor List (前 10%)
 - 主修课程: 会计学, 金融学, 宏观微观经济学, 资产定价, 管理学, 经济计量, 统计学, 精算学

技术能力

- 编程语言: MATLAB, Python (熟练), Stata, SQL
- 技术: Scikit-Learn, PyTorch, TensorFlow, Pandas, NumPy, Matplotlib
- 机器学习算法: CNN, RNN, GAN, MLP, 决策树, 随机森林, XGBoost
- 工具: LaTeX, VS Code, Anaconda, MySQL, Microsoft Excel VBA, Bloomberg, WRDS, Capital IQ.
- 语言: 英语 (熟练), GRE 310, IELTS 6.0
- 证书: 证券从业资格证, 基金从业资格证, BMC 彭博数据终端

工作经历

- 北京利安达会计师事务所 | Reanda, 管理咨询部, 审计员 2022.6-2023.2
- 负责 2022 年中国中冶集团武汉三家子公司的内控与风险管理监督评价工作。具体职责包括: 负责对中国一冶、中冶南方及武汉勘察设计院的采购管理流程进行数据分析和审查, 使用 Excel 和 SQL 对招投标流程数据进行清洗和分析, 进行采购招投标率的统计分析, 以及工程项目分包商管理的内控评价。撰写采购专项审计报告, 使用 PowerBI 进行数据可视化。
 - 负责宁波物流港海外物流园区投资项目的股权和基金投资的可研报告的编写。根据 VDR 平台和现场尽调的结果, 协助完成前期财务尽调报告。在第二阶段, 主要负责建立有限合伙基金 LTSI 的财务估值模型, 进行项目投资估算部分的工作, 包括利用历史数据进行回归分析和蒙特卡罗模拟, 预测并量化基金的潜在风险敞口并以及预期回报, 退出条件判断等, 完成可行性报告中财务估值部分, 并成功通过甲方三会审议流程。
- 小米集团-北京小米移动科技公司 | Xiaomi, 财务部, 融资专员-实习生 2021.9-2021.12
- 独立负责追踪并更新外资券商估值模型: 具体为分析外资机构 (Analyst coverage) 的研究报告中的目标股价 (TP)、销量等预测财务数据, 并使用 Bloomberg 和 wind 统计市场预期等数据, 与内部预测数据对比分析, 并进行总结汇报。同时, 使用 SQL 对数据库进行填充, 记录外资分析师访谈记录等信息, 完善数据库以支持后续分析和报告编写
 - 独立负责记录和分析可比公司的季度财务报表和业绩发布电话会议: 梳理分析关键财务数据, 形成行业研究报告, 涵盖芯片短缺、笔记本/手机/PC 出货量、ESG 等互联网行业课题, 通过数据建模和预测分析未来市场趋势, 定期总结分析结果, 编写详细报告并向管理层汇报。

项目经历

基于 GANs 的金融时间序列建模

Google Colab & Python

- 导师: Dr.Ankush Agarwal
- 在该项目中, 使用生成对抗网络 (GANs) 来研究 FTSE-300 指数的行为模式。借助 PyTorch 框架, 构建了基于多层感知器和卷积神经网络 (MLP-CNN) 架构的生成器和鉴别器的设计与优化工作。提升模型对金融时间序列动态的捕捉与模拟能力以及稳健性。
- 利用 1990 至 2023 年的 FTSE-300 指数历史数据对模型进行训练, 通过不断优化超参数以实现预测误差的最小化, 并进行了随机抽取指数成分股的稳健性测试, 并通过对比真实与生成数据对市场的波动聚集、厚尾分布及时间序列杠杆效应和展示盈亏不对称性, 增强对市场波动性的预测能力。 ([项目链接](#))

毕业设计: 因子挖掘-分析师预测误差因子在投资组合中的应用与优化

Python3 & MATLAB

- 导师: Dr.Miguel Herculano
- 通过沃顿数据库分析 IBES 和 CRSP 数据, 研究了分析师预测误差作为市场不确定性信号的应用, 优化了投资组合。主要研究方法包括机器学习算法和统计分析, 重点在于验证预测误差对股票预期收益率的解释力和投资组合的风险调整回报。通过 Fama-French 六因子回归分析, 超额收益, 夏普比率和信息增益和交易成本等统计分析, 验证了该信号在量化投资中的有效性。 ([项目链接](#))