

陈霖

(+86)18950336780 | chenlin114514@sjtu.edu.cn | 上海

教育经历

上海交通大学

2021年09月 - 2025年06月

统计学 本科 数学科学学院

经济学 辅修 安泰经济与管理学院

GPA:3.67/4.3 (专业内排名5/18)

荣誉奖项: 2022年上海交通大学校长奖(作为上海交通大学学生交响乐团成员获得), 上海交通大学本科生优秀奖学金B等(2021-2022学年与2022-2023学年两次获得), 2023年美国大学生数学建模竞赛H奖, 2022年上海交通大学数学建模校内赛二等奖

相关课程: 数学分析, 高等代数, 概率论, 数理统计, 随机过程, 回归分析与线性模型, 多元统计, 常微分方程, 最优化方法, 大数据分析, 统计软件与算法, 程序设计思想与方法, 数据结构, 并行与分布式程序设计, 计量经济学, 经济优化方法

实习经历

上海乾上泉私募基金管理有限公司

2023年07月 - 2024年01月

量化研究助理

上海

- 在Linux环境下, 使用Python与SQL脚本维护SQL数据库(PostgreSQL)中的现有因子
- 使用并行计算技巧优化因子的计算速度(如使用python中的joblib库, 使用向量化计算等)
- 基于分钟级数据与逐笔交易数据构建因子, 并基于自己搭建的单因子测试系统与回测系统计算各个因子的IC(最高可达7%)、RankIC、多空收益(约1%)、ICIR、RankICIR、多空胜率(最高可达80%)等指标
- 使用正交化、加权平均、回归等方法构建复合因子, 并测试复合因子的收益(平均多空收益约0.7%, IC约6%)
- 使用Python制作CSI300, CSI500等股票池中的Beta直方图, 并可视化各个因子的累计RankIC等指标。

项目经历

基于随机森林模型的地震后建筑受灾等级预测

2024年01月

- 运用Python, 使用直方图、小提琴图等可视化工具对各个特征进行探索性数据分析, 并预处理特征且进行特征工程。
- 使用朴素贝叶斯、决策树、随机森林等模型预测建筑物受灾等级, 并根据对分类结果的混淆矩阵的分析, 通过超参数调优、SMOTE重采样提升模型效果(预测准确度提升约10%)
- 针对不同地区的受灾等级分布进行层次聚类以补充地理信息, 并通过根据聚类区不同使用不同的模型以改进预测效果。

神经网络的量化

2023年12月

- 使用Pytorch在Cora, Citeseer, Pubmed三个数据集上使用PTQ方法完成GAT, GCN, GIN三种神经网络的伪量化。
- 结合UQ(Uniform Quantization), LWQ(Layer-wise Quantization), CWQ(Component-wise Quantization)三种量化方法, 优化神经网络量化后的存储大小(原存储大小的25%)与精度(原精度的95%)。

A Plant Ecological Simulation Model Based on the Gauss-Lotka-Volterra Model

2023年02月

- 使用改进后的Gauss-Lotka-Volterra模型, 在不同土壤、气候、物种数量条件下用微分方程对生物种群的变化进行建模。
- 使用三角函数模拟季节性气候变化, 并使用mathematica对微分方程进行数值求解, 并对各个影响条件进行敏感性分析。

企业高管的海外背景对企业承担社会责任的影响

2023年06月

- 运用高层梯队理论, 控制企业特征(如企业ROA, ROE等)、高管个人特征(如年龄、性别等等)、行业特征后使用聚类OLS对企业高管是否有海外学习经历、海外工作经历对企业CSR得分的影响进行实证研究。
- 对各特征进行Pearson相关性分析, 并使用VIF对回归结果进行多重共线性的分析。

社团和组织经历

SJTU量化分析协会

2023年09月 - 至今

学术部部长

- 负责招新面试, 组织开展“每周一题”活动, 组织分享会活动。

上海交通大学学生交响乐团

2021年09月 - 至今

低音提琴首席

- 作为低音提琴手参与上海交通大学迎新音乐会、大学生艺术展演、上海第十四届优秀管乐团队展演等演出。

技能/证书及其他

- 技能:** Python, C++, R, Stata
- 语言:** 英语(CET-6: 618)
- 兴趣爱好:** 低音提琴, 钢琴, 音乐