



魏宇轩 Max

邮箱: 2153624@tongji.edu.cn | 电话: 18629343537

地址: 上海市杨浦区四平路 1239 号



教育经历

复旦大学

金融工程 硕士 管理学院

2025 年 9 月-2027 年 12 月

上海

同济大学

数理金融 本科 经济与管理学院

2021 年 9 月-2025 年 7 月

上海

- GPA: 91.23 / 95

- 核心课程: 数学分析, 高等代数, 概率论与数理统计, Python 程序设计, 计量经济学, 公司金融, 投资学

工作经历

上海吾执投资管理有限公司

投研部 量化研究员实习生

2024 年 9 月-至今

上海

- 基于各类金融原始数据处理、分析与建模, 进行因子挖掘、策略优化等研究。
- 进行 A 股量价和深度学习因子的研究, 复现完善相应的财报与论文研究。

摩根士丹利证券 (中国) 有限公司

Institutional Equity Division 量化实习生

2023 年 9 月-2023 年 12 月

上海

- 运用市盈率、市净率、企业价值等因子构建量化策略, 采用不同方法 (平均加权、IC 加权、IC-IR 加权) 计算加权因子得分, 选取综合因子得分超过某百分位的股票进行每日更新投资组合。
- 对 100 只不同行业的股票构建持仓策略, 在固定区间内进行回测, 对策略收益与市场收益进行图像的对比分析。

国泰君安期货有限公司

研究所 金融工程实习生

2023 年 7 月-2023 年 9 月

上海

- 构建 SARIMA、LSTM 时间序列预测模型来预测期货相关宏观经济指标, 包括 PMI、PPI、CPI。
- 通过构建逐步回归的多元线性回归模型对已有预测进行优化, 最终结果使整体拟合优度显著提高 14-15%。
- 总结宏观经济指标预测的关键研究结论, 撰写对应的预测报告, 指导对应期货交易的决策过程。

中国国际金融股份有限公司

资产管理部 量化分析师实习生

2023 年 1 月-2023 年 3 月

上海

- 通过 Python 实现数据处理以及结合 CAPM 模型进行资产 Beta 系数的计算。
- 通过 Python 建立 Markowitz 投资组合模型, 结合 iFind 股票数据进行优化资产配置计算, 并绘制有效前沿曲线。
- 通过 Black-Litterman 模型降低 Markowitz 投资组合模型输入参数的主观性, 优化模型的准确性。

荣誉和科研成果

- 全国大学生数学竞赛 (上海赛区) 省级一等奖
- 工行杯全国大学生金融科技创新大赛国赛一等奖
- Mathorcup 高校数学建模挑战赛国赛二等奖
- 美国大学生数学建模竞赛 H 奖 (二等奖)
- IEEE AIARS 2023, *Financial Inclusion in Emerging Economies: The Application of Machine Learning and Artificial Intelligence in Credit Risk Assessment*, 独立第一作者
- 2024 3rd International Conference on Data Analytics, Computing and Artificial Intelligence (ICDACAI 2024), *Machine learning-based market forecasting models and their application to financial investments*, 第一作者

附加信息

- 技能: FRM 一级, 上海市计算机水平考试 Python 三级
- 语言: 英语 (熟练, CET-6: 577, IELTS: 7.0, GRE 335+5), 普通话
- 兴趣: 篮球、健身、音乐