

于济冲

电话:(+86)15075785516 | 邮箱: yujichong85516@163.com



教育背景

北京大学汇丰商学院 | 数量金融 | 硕士

2022.09-2025.06 深圳

- 硕士课程: 机器学习算法、金融机器学习、人工智能、强化学习、高级计量、应用计量、随机金融、应用随机过程

四川大学经济学院 | 经济学 | 本科 | GPA:3.83/4

2018.09-2022.06 成都

- 本科课程: 微积分、概率统计、线性代数、统计学、数据库技术、运筹学、博弈论、计量经济学
- 获得奖项: 四川大学优秀学生、四川大学优秀毕业生、国家励志奖学金、北京大学三等奖学金、全国大学生数学竞赛二等奖、大学生创新创业训练计划省级立项结题、全国大学生市场调查分析大赛全国三等奖

实习经历

上海稳博投资管理有限公司 | 量化研究员实习生

2024.08-2024.10

- 特征构建: 基于分钟k线和L2数据构建日内波动率、HHI指数、以及大单涨跌幅、价格分歧程度等共46个特征。
- 混频模型: 搭建分钟频和日频两个特征输入框架, 利用ResNet提取分钟频价量信号, 搭建ASTGNN网络, 利用两条GRU分别提取alpha特征向量和属性特征向量, 之后将时序信号导入图模型进行截面训练; 加入对抗训练样本, 使用分钟频原始价量特征和日频特征进行周频预测, 预测效果目前做到5日vwap2vwap的RankIC超0.13。
- 分钟模型: 利用iTransformer、BiaGRU、Crossformer等时序模型多模型融合, 进行5分钟截面训练, 预测label使用的close进行pct处理, RankIC达到0.09, 预测选股能力表现优秀。

上海艾方资产管理有限公司 | 量化研究员实习生

2024.06-2024.08

- 日频模型: 采用MADL和可微分RankIC作为新的损失函数, 与原IC损失做等权处理, 利用Resnet聚合分钟频特征为日频, 并采用GRU-Transformer结构进行时间序列学习, 相较于日频图网络提升4%。
- 混频模型: 构建ASTGNN自适应图神经网络, 利用分钟频、日频的信号进行学习, 分别用GRU和TCN提取分钟频信号, 与GRU提取的日频信号结合, 利用股票自身特征向量作为邻接矩阵, 之后构建GATs图网络学习股票间截面信号, 预测未来收益率, IC表现0.12。构建GRU-Attention-GATs混合频段网络, 利用GRU和Attention拼接输出时序提取特征, 用行业和股票因子风格暴露向量1:1加权构建图网络加权邻接矩阵, 利用分钟频、日频的混合频段的价量因子进行预测。构建两阶段GRU残差网络, 第一阶段利用日频信号对未来10天收益率进行拟合, 第二阶段利用分钟信号对残差进行拟合, 两阶段网络IC表现相对于基准提升8%。

易方达基金管理有限公司 | 指数量化研究员实习生

2024.05-2024.06

- AI+网格交易策略: 构建股票中心度、收益率因子等日频价量因子。使用LightGBM和GRU进行股票收益排名预测, 并对指数进行成分股加权并量化择时。构造AI+网格交易策略, 搭建回测框架, 沪深300年化15.97%, 夏普1.25。

南京序明基金管理有限公司 | 量化研究员实习生

2024.02-2024.05

- 因子构建: 利用另类数据生成文本因子; 依据股票关联度概念, 构建时间中心度及股票中心度系列因子, IC最高表现为4%及分层回测良好。
- 日频模型: 对沪深300、CSI500、CSI1000指数成分股进行专家模型训练, 并分别用于各自预测, 回测效果表现年化10%。依据Barra因子构建风格动量因子, 并将Barra因子和短期风格动量与价量因子的输出层结合, 进行预测输出结果, 样本外IR达到0.7。对BiaGRU、HIST、Mamba和iTransformer模型进行时序模型测试, 以负IC和因子相关性作为损失函数进行多任务学习, 最终得到因子在测试集IC值达到9.8%。
- 分钟模型: 利用分钟频价量因子, 利用LightGBM学习截面特征, GRU学习时序特性, 用Transformer学习股票间信息并对三个模型集成, 采用滚动训练的方式输出集成后的因子, 分钟频IC表现超过9%。

杭州希格斯投资管理有限公司 | 量化研究员实习生

2023.08-2024.01

- 股票预测: 用研报文本数据微调FinBERT模型, 对研报和新闻数据进行文本分析, 用FinBERT的隐藏层输出的768维特征作为分钟频率文本特征。使用GRU网络对一天以后的CSI500成分股的收盘价涨跌进行预测, 最优拟合效果稳定接近54%; 对15:00-9:30之内的数据进行15分钟采样, 预测开盘价的涨跌, 预测准确率为53%。
- 股指预测: 利用GRU网络对CSI500指数和沪深300的涨跌进行预测, 使用15min数据滚动预测+5min收益涨跌, 加入量价特征观察舆情特征的边际收益; 调整GRU网络结构, 将价量因子和文本另类因子进行拼合, 滚动训练并输出预测结果, 实际预测结果准确度稳定在54%。

华泰证券研究所金融工程组 | AI量化实习生

2023.03-2023.08

- 因子挖掘: 使用GRU神经网络挖掘因子, 样本外IC表现为0.08, 并进行分层回测。多频段研究: 将周频和月频数据同日频数据一起, 进行多频段因子挖掘。模型研究: 将TCN时序卷积网络进行研究, 样本外IC最优表现为0.1。学习率研究: 对不同的学习率衰减进行研究, 热重启学习率训练效果为0.08。训练方法研究: 使用SAM方法和SWA方法对模型进行调整, 模型样本外IC表现0.1。
- FADT: 利用CSMAR舆情数据对FinBERT金融语料预训练模型进行微调, 使用分析师研报文本数据进行情感分析, 之后将微调好的模型用于20-23年的研报文本分析, 并利用XGB机器学习模型进行超额收益预测打分并生成因子。

项目经历

Optiver - Trading at the Close

2023.12-2024.03

- 利用原始高频订单簿数据, 生成171个高频因子, 并使用LightGBM进行特征筛选, 选取最优150个因子作为特征。
- 使用GRU和LightGBM分别对收益进行预测涨跌, 并对两个模型赋0.5权重, 最终排名前20%。

《基于机器学习的银行信贷风险违约风险评估》

2023.02-2022.04

- 对从汇丰银行的原始数据进行预处理, 应用SMOTE方法进行上采样解决数据不平衡问题, 进行数据分箱操作部分解决数据缺失问题。使用逻辑回归、决策树、随机森林等算法进行模型拟合, 模型拟合效果良好。