

杨阳

男 | 年龄: 22岁 | 15199141902

求职意向: 证券/基金/期货 | 期望薪资: 10-11K | 期望城市: 上海



个人优势

熟练掌握 python , 对量化充满热爱。

教育经历

浙江大学	硕士	经济学	2024-2027
浙江大学	本科	统计学	2020-2024

实习经历

宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙） 量化研究员 2023.12-2024.04

1-低频日频因子挖掘:负责“股票相似度”因子课题。从传统财务指标、行业与地理、股票概念归属等方面衡量股票之间相似性,以相似股票的过往收益预测焦点股票的未来收益,原创构建出了一套相似度因子。回测 20170101--20211231,原创构建出的股票概念相似度因子的改进因子年化收益率可达 40%,胜率 60%。

2-日内 5 分钟频因子挖掘:利用 5 分钟的市价订单数据,构建了一系列因子。其中原创构建的“市价订单尾盘偏度均值”因子,回测 20170101--20211231,因子的年化收益达 25%,换手率为 20%,胜率达 70%。因子挖掘:从实际投资逻辑出发,使用统计方法分析各种大型数据集的潜在阿尔法,构造量价等因子;目前已有 10 个因子通过了公司实盘所使用的神经网络模型的有效性检验,显著提高了资产组合收益,纳入到了神经网络模型中。

3-其他:复现了《2024 因子日历》和其他研报来源的近 60 个日频因子,对于因子的复现和挖掘步骤较为熟练。

上海稳博投资管理有限公司 量化研究员 2023.07-2023.12

1-因子挖掘:研究热门股票的超跌反弹策略,利用分时成交单数据、龙虎榜数据等分析短期筹码交换的信息,并利用量价数据构建分歧信号与日 k 企稳信号、尾盘抢筹信号等,进一步构建高盈亏比的纯多头因子。研究行业不同发展趋势下龙头股、人气股等个股之间的差异性和联系,构建行业反转等相关因子。研究判断大额投资者影响强弱的股票特征,构造收益率噪声因子等

2-微盘域选股:构建技术、估值、反转、波动率、换手率等 42 个因子,在中证 1000,国证 2000 和自行构建的“微盘 500”股票池中构建指数增强策略,并回测结果,回测区间 20151231--20230615(测试集半年, rolling window)。策略在中证 1000、国证 2000 股票池中年化超额收益率分别为 9.24%, 12.66%:在市值下潜力度更大的“微盘 500”股票池中年化超额收益率达 13.65%。换用 TopK 策略后,自行构建的微盘 500 股票池依然在超额收益及其回撤上保持优势。

3-机器学习模型选股:构建“股票归属类型”,“注册地所在城市”等 7 个文本类型的分类特征,用 CatBoost、LightGBM 处理这些分类特征,并使用 automl 进行自动调参:,加入上述 42 因子一起预测股票收益。在全 A 股票池、国证 2000 股票池和中证 1000 股票池均取得年化收益和年化超额收益的大幅提升。回测区间同上,在国证 2000 中表现最好,年化超额可达 24%,换手率 16%,月胜率 80%。

4-策略研究:因子动量策略研究与开发，基于估计的因子收益率数据，筛选出因子动量稳定/可延续的数个因子，基于因子过去时间段内的表现分配初始权重，并根据市场表现使用类布林带策略进行动态调整权重，对每个因子分别构造资产组合进行买卖，并适时进行风格切换；