

李任

(+86) 138-9343-2276 | 2013455@mail.nankai.edu.cn

天津市津南区海河教育园区同砚路38号 南开大学



教育背景

南开大学 金融学院 金融科技方向，硕士 2024.09-2026.06

- 所获荣誉：2024年度研究生入学一等奖学金

南开大学 金融学院 金融学，本科 2020.09-2024.06

- GPA: 3.78/4 (均分: 90.1/100)
- 所获荣誉：学业优秀奖学金(2023年)、社会公益奖学金(2023年)
全国大学生数学竞赛天津赛区一等奖(2023年)、全国大学生英语竞赛天津赛区三等奖(2023年);
- 相关课程：概率论 (99.3)、多元函数微积分 (100)、经典统计学与MATLAB应用 (95)、计量经济学 (93.8);
Python与机器学习入门 (95)、Python与旅游数据挖掘 (94)、数据结构与算法 (92.3);
经济数据分析 (96.4)、金融计量经济学 (93.6)、金融工程 (93)、固定收益证券 (94);

科研经历

知名度、流动性因子对股票收益率影响研究 个人论文 2023.01-2023.03

- 基于股票面板数据建立Fama-Macbeth回归模型，探究北交所股票知名度、流动性等因子对其超额收益率的影响
 - ✓ 指标构建：基于2020年11月-2022年11月期间无风险利率以及由新三板精选层上市北交所公司的换手率、成交额、成交量、股东数量、日收益率等指标的面板数据，利用python进行数据清洗及时间序列预处理，构建shadowcost、ILLIQ指标作为公司知名度因子、流动性因子；
 - ✓ 模型构建：基于已构建的shadowcost、ILLIQ、上市时长、市值规模等因子，利用python建立公司超额收益率对各因子的Fama-Macbeth回归，得出结论（知名度越高、流动性水平越高，股票超额收益率越低，结论显著）；
 - ✓ 稳健性检验：在北交所开市（2021.11）前后两个时期将超额收益率对各因子做Fama-macbeth回归，检验结论是否显著（在北交所开市前时期通过检验；在北交所开市后时期仅shadowcost通过检验，ILLIQ未通过检验）。

项目经历

基于LSTM等模型的商店销量时间序列预测 个人项目 2022.03-2022.05

- 在南开大学计算机学院王恺副教授组织下，完成Kaggle网站机器学习竞赛项目：Store Sales-Time Series forecasting
 - ✓ 数据清洗与预处理：利用Python pandas库读取Kaggle网站数据为dataframe格式，数据包含商店编号及其所在城市、商店中各类商品交易量、交易日期、是否促销、当日石油价格、节假日日期等。将日期数据、文本数据分别转化为datetime格式、onehot编码格式，查看缺失值情况发现仅油价数据有较少缺失，利用fillna函数以向前填充方式填充；
 - ✓ 描述性统计与可视化：利用matplotlib、seaborn库绘制油价时间趋势、商品总销量时间趋势、交易量与销量散点图等图像，分析各属性变量与标签值（销量）之间关系，挑选与销量关系最紧密的商店编号、商品类别、油价、交易量、日期、促销与否作为预测标签值的最佳属性，利用merge函数合并构建训练集数据样本；
 - ✓ 模型训练与预测结果评价：搭建LSTM（长短周期记忆）网络、SVR（支持向量机回归）模型、随机森林模型、线性回归模型，在训练集数据样本上进行交叉验证，并对各模型迭代调整到合适参数。在最优参数下，以RMSE为评价指标，发现模型预测准确性排序为：SVR>随机森林>线性回归>LSTM，但总体而言，各模型预测误差均较大。

实习经历

东吴证券有限责任公司|研究所 传媒互联网组（新财富组） 2022.12-2023.02

- 数据分析：检索Choice、Wind数据库及公开资料，收集行业及重点企业财务及经营数据，利用Excel整合分析并制图；
- 行业调研：参与路演、业绩说明会等并整理会议纪要；通过计算市场占有率、下沉市场增长率等协助完成对互联网电商行业的未来趋势预测；整理互联网行业2019年至2022年政府监管政策，分析政策转向对互联网平台经济的影响；
- 深度研究：参与撰写《港股牛市的复盘和展望》深度报告，从经济基本面、政策面、海内外流动性、估值角度对港股2002年至2023年牛市复盘，对比恒生指数与沪深300指数、标普指数，分析牛市动因，并进一步展望港股与互联网板块市场前景。

研究兴趣及专业技能

- 研究兴趣：计量经济学（统计&因果推断），金融时间序列分析，金融数学（随机分析），机器学习，运筹与优化
- 计算机技能：Matlab, Python, 机器学习（Keras, Tensorflow等），数据分析与可视化（Numpy, Pandas, Seaborn等）
- 语言技能：CET6（601），雅思（6.5）