

# 李思桐

ruc.sitongli@gmail.com • LinkedIn • Github • 18801375227



## 教育

明尼苏达大学双城分校,金融硕士&商业分析硕士

2023 年-2025 年

课程: 优化与建模 高级机器学习 非结构化数据分析 时间序列分析 金融科技

中国人民大学,工商管理学士-智能会计方向

2019 年-2023 年

课程: 高级会计学 财务会计学 会计学 金融学 数据结构与算法 机器学习 深度学习 人工智能

图宾根大学,交换

2021 年

课程: 计量经济学 宏观经济学 微观经济学 面板数据分析 国际贸易计量分析

## 实习经历

中金公司, 研究部策略组

2023 年 5 月 - 至今

- 结合关联算法, 聚类算法, 对港股行业关联度进行挖掘, 构建大类行业配置策略
- 协助分析师完善组内自动化模型, 自动生成图标, python。每周自动生成相关报告
- 基于增长、利率以及政策不确定性选择代理指标来构建宏观因子, 指导港股市场分析
- 选取经济周期指标, 结合 ARIMA 和滤波方法挖掘周期信号, 构建美国周期轮动模型

嘉实基金, 固定收益策略研究部

2022 年 12 月-2023 年 05 月

- 每日对债券市场成交数据和报价数据按照行业、交易量、产品、久期分类并进行作图分析
- 每日跟踪本组持仓内主体及其上市子公司的财务披露情况与市场舆情。维持信用久期持仓稳健
- 利用 Campisi 模型对本组组合, 嘉实持仓及全量债券进行收益拆解与业绩归因并完成组内数据库建设
- 利用机器学习 (Ridge, Lasso) 结合凸优化策略, 对债券基金日频久期进行测算
- 部署基于 XGBOOST&注意力机制的多因子债券定分类定价模型, 预测精度 72%, 精准度稳定提升 80BP

中金公司, 资产管理部

2022 年 07 月-2022 年 12 月

- 从资金面, 流动性, 大宗商品价格对每周宏观经济情况进行跟踪, 并给出下周债市策略展望
- 对每月社融、通胀进行点评分析, 并结合货币政策、信贷投放、地产政策对债市进行下月策略展望
- 通过对转融通官网网页进行解析, 爬取近三年的转融通数据为团队制作数据库和自动生成数据周报,
- 分析交易日股价与转融通出借量、价格, 发现股票发行价与转融通出借量整体上呈现正相关关系
- 研究公司基本面与员工持股计划之间的相关性, 发现实施员工持股计划之后公司基本面平均变差 2.5%

嘉实基金, DataLab

2022 年 01 月-2022 年 07 月

- 通过券商研究团队数据库, 地方协会官网等渠道, 定期跟踪各国新能源车销售情况、全国新能源汽车销售情况数据及锂电池及相关原料生产销售价格数据, 利用 SQL 制作数据库
- 搜集新能源车销售量数据、各车型参数及相关车企智能化程度研究。完成一篇新能源车企研报
- 基于线性回归方法, 测算基金针对新能源车企的持仓并开发投资策略。并完成回测和 IC 计算
- 基于 XGBOOST 方法, 探究光伏材料、锂电材料价格对新能源企业股价的影响并开发投资策略

## 项目经历

加密货币技术面分析-对加密货币数据使用核回归方法平滑后检测五种加密货币技术面存在的投资机会(Lo et al.(2000) FOUNDATIONS OF TECHNICAL ANALYSIS)

基于深度学习的金融数据挖掘-参与预期论文基线模型 Attention-LSTM 的制作。(IJCAI'17); 使用 python 与爬虫技术制作对应论文的数据库并利用 glove 模型向量化

中国法律数据分析-对 18000+法条中的刑期、金额、地区进行清洗、提取并对文本进行向量化建模及利用 XG boost 模型针对刑期金额进行实证研究, 探究不同因素对量刑的影响

## 技能

- 语言: 英语 (精通) 德语 (入门)
- 软件: Microsoft Office (Word, PowerPoint, Excel, Access), PowerBI, Tableau, Git, AWS STATA, SAS
- 编程语言: Python(Pandas, Numpy, Scikit Learn, Pytorch), SQL, noSQL(MongoDB), R, Java, HTML, CSS, JavaScript, VBA, Shell Scripting
- 技能: 机器学习, 深度学习, 时间序列分析, 财务建模, 数据结构算法, 网页爬虫, 网页制作, 可视化 因果推断