

# 王冠嵩

对数据敏感，学习能力强。

有经济金融数据清理和分析经验。

熟悉经济模型，资产定价理论，以及主要统计/估计方法。

寻求可以运用并提升数理分析技能的职位。

手机: 18624091940

邮箱: wangguansong@outlook.com

网站: <http://guansong.wang>

GitHub: wangguansong

## 教育背景

### 北卡罗莱纳大学教堂山分校

金融计量经济学，硕士，博士ABD

教堂山，美国

2007-2014

- **核心课程：**高级计量经济学，时间序列，计算计量经济学，测度论，资产定价，离散和连续时间金融。
- **硕士论文：**Realized Kernels with Moving Average Noise and Optimal Weights.  
考虑当高频交易数据的误差存在时间相关性时，RK (Realized Kernels) 波动性统计量的偏差，并提出修正方法。
- **其他研究：**
  - 对比利用含有误差的高频市场数据估计日波动性的各种非参数统计量
  - GMM的最佳对角加权矩阵以及其效率边界
  - GMM最大熵方法的实际表现实验

### 北京大学

元培计划（学院），经济学学士

北京，中国

2003 ~ 2007

- **主要课程：**高等数学，概率统计，计量经济学，随机过程，计量经济学，计算概论，经济学，货币银行学。
- **调研：**三峡移民的生活状态（2004）
- **毕业论文：**小额信贷额度的微观经济学分析

## 研究项目

### 道琼斯成份股的高频市场数据；每日波动性的非参数统计量

- 下载道琼斯指数从1992年到2013年成份股的高频市场数据（TAQ数据库，约400亿条记录）。
- 调出并清理每只股票在每天的高频数据。
- 探测清理离群值，创建不同取样频率（每交易，每秒，每2秒，等等）的价格时间序列。
- 创建成份股和指数的每日波动性非参数统计量的数据库。

### 沪深股票每日价格、交易明细以及财务信息的下载与清理（R环境）

- 下载沪深股票每日价格的历史数据，近5日的交易明细，以及资产负债表等信息。
- 清理、提取、整合相关数据。

### Zillow网站网页数据抓取

- 编制Zillow网站西雅图地区的所有房产列表。
- 从房产网页中抓取所需信息，如基本概况，目前状态，卖价、租金或估值。

### 中国五市空气指数历史数据

- 收集并清理从2008年到2014年中国五个城市的每小时空气指数（AQI）。
- 分析空气指数的分小时、分天、分月的变化规律。

## 工作经历

### 网络平台交友资料分析

- 收集、清理并解析HTML文件和中文文本。
- 统计年龄、身高、地点等的分布，挖掘描述中的高频词。

### 中国平安人寿保险股份有限公司

辽宁区域拓展部，实习

沈阳，辽宁

2015/10~2015/11

- 参加培训，组织学习。

### 红旗在线网站

网站维护

北京，中国

2004~2005

- 创建网站后台ASP数据库。
- 维护网站服务器，为内容作者提供支持。

## 技能

### 计算编程

R，C/C++，Python，Matlab，Shell，SQL，Hadoop

### 网页制作

HTML & CSS，Javascript，PHP

### 语言

英语：精通