

王博

电话: 15955581917 | 邮箱: wangbo24@tju.edu.cn



个人优势

985 本硕背景: 吉林大学会计学 (专业前 3), 天津大学金融学保研, 以第二作者在《会计研究》(中文核心) 发表论文。

扎实学术基础: 财务会计/金融/数学基础扎实 (核心课程均分 94+), 精通 Python 量化建模 (机器学习、因子开发、策略回测)。

金融实战经验: 主导事件驱动/高频因子/CTA 策略开发, 事件策略年化收益达 24.8%, 夏普比率 1.1, 最大回撤 16.3%。

教育经历

天津大学 (985, 保送) 金融 硕士 2023.09 - 2026.01

- 核心课程: 公司金融 (92)、投资学 (88)、金融计量经济学 (86)、金融工程理论、Python 分析、高级商业分析、数据可视化。
- 荣誉奖项: 天津大学二等奖学金 (前 15%)

吉林大学 (985) 财务与会计 本科 2019.09 - 2023.06

- 核心课程: 微积分(94)、线性代数(98)、概率论(99)、C 语言(91)、管理会计(91)、微观经济学(94)、宏观经济学(93)
- 成绩荣誉: 3.8/4.0 专业前 3; 一等奖学金 (前 5%)、二等奖学金 (前 10%)、校优秀学生 (前 5%)、院优秀学生 (前 10%)

实习经历

上海量魁私募基金管理有限公司 投研部门 | 量化研究员 2025.05 - 2025.08

- 开发事件驱动策略: 分析 A 股 ST 股票公告事件时间分布和持有收益, 实证扭亏业绩预告公告发布后 40 天累计超额收益达 7.0% (t 值=2.9); 挖掘日内失衡因子与超预期因子对公告事件收益的促进作用 (多头组合收益分别提升 2.2%和 3%)
- 机器学习预测模型: 整合月度频率盈利能力、治理情况等基本面信息与基础量价等 20+ 特征, 使用 Random Forest、XGBoost 等二元分类机器学习模型滚动预测次月摘帽可能性, 样本外准确率达 77.6%
- 回测框架设计: 以摘帽概率较高的 ST 企业作为股票池且每月更新, 涨停触发买入信号持有 20 日平仓或单日下跌 4.9%止损, 2018-2025 回测期间年化收益 24.8%/夏普比率 1.1/最大回撤 16.3%

渤海证券 对冲量化部门 | 量化交易实习生 2025.01 - 2025.05

- 高频因子开发: 基于股票逐笔成交数据的非孤立单构建每日成交不平衡因子, 经市值中性化+涨跌幅正交化处理, 因子ICIR达2.52, 多空对冲组合年化收益25.51%/最大回撤10.07%; 对因子频率、孤立成交单窗口期等参数进行敏感性分析
- 商品期货策略: 针对主力合约开发Aberration、Boll、DMA、MA、MACD均线策略, 每3月根据流动性变动因子调整多头组合, 针对每一品种以过去3个月夏普比率最高的均线策略作为择时策略, 2021-2025.04期间回测年均收益12.2%/最大回撤11.6%

申万宏源证券 投行部门 | 投资助理 2022.09 - 2022.11

- 参与IPO财务核查: 协助进行尽职调查、按照质控部门要求补充招股说明书财务信息底稿; 具体负责拟上市企业采购、销售数据的公允性调查以及与同行业企业的对比分析; 核查内部控制环节的可靠性并对具体的业务流程施行穿行测试
- 测试内控流程: 协助项目组核查会计事务所提供的拟上市企业财务状况分析, 完善关联企业信息, 核实销售借贷等业务活动的真实性

项目经历

ST 股票事件驱动策略 | 独立研究项目 2025.05 - 2025.08

- 事件后收益: 对发布后存在明显持续收益的事件构建事件驱动型策略, 其中扭亏业绩预告公告后持有 40 日的平均累积超额收益为 7%, 涨停事件后持有 90 日的平均累积超额收益为 6.7%; 对于首次公布扭亏或在第二季度的涨停事件表现更佳
- 事件前预测: 基于指标发布日严格匹配公司财务指标与量价因子, 使用 XGBoost 等机器学习开发 ST 企业摘帽概率模型, 样本外预测准确率 77.6%; 对于摘帽概率高的股票构建 DQN 网络时序模型细化买入卖出时点

大宗商品 CTA 策略设计 | 渤海证券项目 2025.03 - 2025.05

- 构建动态调仓框架: 每 3 月调整期货品种组合, 以交易量和换手率变动因子交叉选股, 以过去 3 个月夏普比率最高者为择时策略
- 日内收益预测: 基于快照数据构建多开空开不平衡因子, 调整因子计算频率与未来收益率窗口构建相关系数矩阵, 筛选最优参数组合

股票逐笔成交因子开发 | 渤海证券项目 2025.01 - 2025.02

- 创新因子构造方法: 构建成交单不平衡因子的基础上使用累积涨跌幅 (反转因子) 进行正交化处理, 因子有效性指标 ICIR 提升 50%
- 因子多角度验证: 剔除常用的市场风格因子影响之后, 因子年化 ICIR 提升至 2.92 及多空组合的信息比率达 1.8

科研经历

《地方政府债务治理与企业避税》 | 《会计研究》 第二作者 2025.04

- 政策效应评估: 以《预算法》实施为准自然实验, 基于企业避税"收益-成本"权衡理论, 分析地方政府债务治理对企业避税的影响。
- 创新数据库构建: 整合 Wind/CNRDS 平台数据, 构建地方融资平台有息债务数据库, 覆盖 2000+ 企业样本。
- 严谨实证检验: 通过 Stata 完成基准回归、稳健性检验、异质性检验、机制等数据分析过程, 运用模糊匹配技术识别集团避税证据。

专业技能

- **语言：**中文母语，英文流利 CET-4（555），CET-6（534），可作为工作及科研用语。
- **证书：**初级会计证书
- **编程：**Python（熟练使用 pandas 数据清洗、sklearn 建模、NumPy 数值计算）
- **量化工具：**精通策略回测框架、因子 IC 分析、参数敏感性测试