



教育背景

2019.09 - 2023.06 吉林大学 (985) 财务与会计

本科

- 成绩: 3.7/4.0 专业排名: 3 荣誉奖项: 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%)
- 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)

2023.09 - 2026.02 天津大学 (985, 保送) 金融

硕士

- 荣誉奖项: 二等奖学金 (前15%) 核心课程: Corporate Finance (92)、投资学 (88)、金融计量经济学 (86)

实习经历

2025.05 - 2025.07 上海量魁私募 | 投研部门

- 负责事件驱动型策略开发: 统计事件发生的时间分布并计算事件发生前后的累计超额持有期收益情况; 对于在发生后存在超额收益的事件使用公告日后第一个可交易日设计策略进行回测; 考虑样本在不同行业、年份、具体内容中事件收益的差异
- 对于仅在发生前存在超额收益的事件, 通过企业财务指标、公司治理情况、量价因子等构造特征, 使用SVM、Preceptron、Logistic回归、Random Forest、Xgboost等二元分类机器学习模型预测在未来一段时间内的事件方向, 对预测概率较大的事件提前介入进行回测

2025.01 - 2025.05 渤海证券 | 对冲量化交易部门

- 负责高频数据中量化因子的开发; 完成日内毫秒级数据的提取和清洗, 从中挖掘选股因子及其异质性特征; 通过回测获取因子的IC表现及对空组合绩效并对涉及的参数进行敏感性测试; 追踪国内外顶刊和研报为因子的预测能力提供合理的理论解释
- 负责CTA策略设计; 针对每种大宗商品期货开发和优化Aberration、Boll、DMA、MA、MACD等策略; 根据流动性等基本面对构建和优化投资组合, 同时构建合理的择时策略框架; 策略的回测结果中近三年收益均值达到7%左右

2022.09 - 2022.11 申万宏源证券 | 投资银行部门

- 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公司企业的对比分析; 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
- 协助项目组核查会计事务所提供的企业财务状况分析; 完善拟上市企业的供应商、经销商等关联企业的信息, 核实拟上市企业销售、借贷等业务活动的真实性

项目经历

2025.05-2025.07 ST股票的事件驱动型策略—量魁私募

- ST股票多由于基本面困境被风险警示, 常规的风格因子也常常排除ST股票的干扰。而ST股票投资的价值在于市场对基本面反转的预期并反映在某些事件公告中。研究发现在ST股票发布扭亏类型的业绩预告对未来股价有短期的预测能力, 40天持有累积超额收益达到7%
- 但ST股票在财务报告、摘帽当日均是仅在公告前才有股价上涨趋势, 说明知情交易的存在或公告的确定性较高。对此使用公告前逐笔成交数据构造知情交易的代理变量或基于盈余公告计算超预期程度。同时, 本研究还通过企业财务指标、公司治理情况、量价因子等构造特征, 使用Logistic回归、Random Forest、Xgboost等二元分类机器学习模型预测在未来一年内的ST股票摘帽的概率

2025.03-2025.04 CTA大宗商品期货策略设计—渤海证券

- 传统期货策略在2020年之后失效; 本项目以持仓量提取期货主力合约作为期货资产样本范围, 根据交易量或结合持仓量与交易量进行标的选取, 每3个月调整一次交易品类; 同时每年匹配的择时策略选取为过去一年Aberration、Boll、DMA、MA、MACD中表现出最高夏普比率的策略。最终项目中CTA组合在近三年的年收益表现保持在7%左右

2025.01-2025.02 股票逐笔成交类因子开发—渤海证券

- 基于逐笔成交数据中净买单强度构建的成交不平衡因子在2021年之后预测效果不佳, 可能源于净买单引起的当期涨跌幅变化与未来收益负相关; 本项目在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, 分理出集中成交或大额成交的买卖单重新构造因子进一步提升因子的预测能力。剔除常用的市场风格因子影响之后, 因子年化ICIR及多空组合的信息比率进一步提升

科研经历

2024.06 - 2025.04 《地方政府债务治理与企业避税》 | 第2作者《会计研究》

- 论文以2015年新《预算法》的实施作为一项准自然实验, 基于企业税收筹划的“收益—成本”权衡, 系统考察了地方政府债务治理对于企业避税行为的影响; 主要负责全文的实证检验以及理论框架的搭建部分, 并梳理最终书写逻辑
- 以Wind数据库和CNRDS数据库构建地方融资平台新名单及地区融资平台有息债务的独特数据; 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; 运用模糊匹配从CSMAR数据与税调数据终获取集团避税的证据
- 通过分析百余篇国内外顶级期刊完成本文中“收益—成本”理论的书写, 为宏观政策如何影响企业行为提供了严密的逻辑框架; 最终论文投稿于《会计研究》期刊

职业技能

CET-4 (555)、CET-6 (534)、初级会计证书、熟练使用 Python 中 pandas、numpy、Pool、sklearn