**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69.2%，夏普比率1.9，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69.2%/夏普比率1.9/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及多空组合的信息比率达1.8，通过机构风控测试。

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