 **王博**

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

**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 - 2026.01 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 | 量化研究员**

* 针对ST股票建立业绩预告、业绩报告、风险警示撤销、涨停等8种公告事件数据库并统计各类事件的时间分布以及发布前后的累计超额收益；对于在发布后存在明显收益的事件使用公告日后第一个可交易日构建**事件驱动型策略**进行回测；对于仅在发生前存在超额收益的事件，以**日内失衡因子**衡量事件前的知情交易观察窗口期的变动及对短期收益的预测能力，并以**超预期因子**观察不同分组在发布后是否存在股价漂移
* 鉴于最终摘帽的企业在此之前的事件窗口期表现更高的收益，因此通过企业盈利能力、成长潜力、治理情况等基本面特征以及基础量价构造**多因子体系**，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，样本外预测准确度为77.6%；以概率较高的ST企业作为股票池并每月调整，以涨停事件为买入信号持有至20日和跌停熟早日，获得69.2%年均收益、1.9的夏普比率和16.3%的最大回撤

**2025.01 - 2025.05 渤海证券 | 对冲量化交易部门 | 量化研究员**

* 基于股票逐笔成交数据挖掘每日**成交不平衡因子**并在月底回看20日转换为月度频率；剔除ST、停牌样本并对因子做横截面市值中性化和当月涨跌幅正交化处理；在2016-2024期间因子月度IC均值达0.041、**年化ICIR**为2.52，多空对冲年化超额收益为25.51%、信息比率为1.96
* 针对大宗商品期货的主力合约开发和优化Aberration、Boll、DMA、MA、MACD等**均线型策略**；根据**流动性变动因子**构建多头组合并每3月调仓，同时对每种期货选择5种均线去年表现夏普比率最高者为择时策略；2021-2025.04期间回测结果中年均收益达12.2%、最大回撤为11.6%

**2022.09 - 2022.11 申万宏源证券 | 投资银行部门 | 投资助理**

* 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
* 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，基于企业避税的“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；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
* 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数据与税调数据获取集团避税的证据

**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