

# 梁镇

15801706616 | liangzhenht@163.com

32岁 | 八年工作经验 | 上海



## 工作经历

蚂蚁集团 - 资产配置和智能投顾组长 财富策略部

2020年06月 - 2025年02月

其中20-21年主要做算法工程师，21-25年转做金融业务方向

### • AI投研/投顾应用（支小助、蚂小财）：

深度参与大模型在智能投研（2B）和投顾（2C）领域的落地应用，主导支小助、蚂小财、蚂蚁财富APP等的专业能力建设部分。

1）协同产研，构建投研投顾知识库（包括专家调研、市场分析报告，20+宏观分析框架、100+行业分析框架，20+商品分析框架等），通过RAG检索提升专业问题生成效果；构建市场、基金/股票产品、用户账户量化分析和诊断工具，通过function call调用。最终实现AI助手可高精度回答市场异动解读、行情分析、基金诊断、个性化资产配置方案、用户收益分析和归因、基金推荐等专业问题，相关问题解决率提升到90%+（基座模型仅40%+）；参与prompt和样本生产和改写，以及GC内容的打标和评测标准化，通过sft微调训练，提升生产内容的严谨性和一致性。

2）协同运营，设计和改进全场景的问答铺设，相关内容深度聊天用户和采纳服务用户超百万。

### • 资产配置和投顾策略研究：

1）自上而下的资产配置研究体系。宏观层面，包括基于驱动力模型的中长期资本市场预测、宏观周期模型、高频数据nowcasting和历史情景匹配；中观层面，包括景气度、行业政策量化、截面因子轮动、机构一致预期等；微观层面，包括资金流、拥挤度、基金持仓高频跟踪等。

2）投顾组合管理。公募组合，以偏股基金指数为基准，业绩稳定在同类前40%；针对高端客户定制产品组合（5年封闭期），24年年化收益7.7%，回撤1.1%。

3）对客投顾策略和服务。作为投顾策略负责人，牵头相关服务建设，团队9人（实线4人）。其中高客以资产月度检视、财富规划为主，不定期进行大事点评、异动分析等服务；大众用户以行情解读、持仓收益分析为核心，进行内容和工具服务。24年相关服务覆盖人数600W+，引导GMV近千亿（绝大多数通过理财师和AI覆盖）。

海通证券 - 金融工程分析师 研究所

2017年06月 - 2020年06月

参与完成专题报告20余篇，课题百余篇。主要包括：

- **大类资产配置**：根据宏观变量与标的资产价格的关系构建交易信号，对大类资产进行配置（股、债和商品）。同时基于外生变量进行市场风格、板块以及行业的轮动模型构建。
- **基金产品研究**：撰写海内外基金市场调研课题；撰写基金择时能力评价相关课题；编写基金评价模板；根据基金持仓相似度构建网络中心度选基策略等。
- **CTA策略研究**：挖掘商品期货共同因子，构建中长期因子投资组合；黄金期限套利策略、黑色产业链套利策略；日间趋势策略、日内高频策略。
- **另类数据和知识图谱应用**：挖掘另类数据，包括产业链上下游、外资持仓、舆情、专利、上市公司关联关系等，构建事件驱动策略（如客户企业业绩预增）和另类量化因子（如关系网因子的中心性和溢出效应）。构建资源品行业知识图谱，进行资源品基本面建模和预测。

团队荣誉：2017、2019年新财富分析师评选金融工程团队前五、水晶球前三。

## 教育经历

同济大学 - 金融 硕士 经济与管理学院

2015年08月 - 2017年05月

西南财经大学 - 数学、金融学 本科 经济数学学院

2011年08月 - 2015年05月

## 其他

1）熟悉AI金融领域落地应用全流程，可根据业务需求构建特定领域知识库和工具，扩展模型功能，并通过prompt和样本改写微调大模型生成结果，实现更好的AI应用效果；

2）熟练使用Python、Matlab、R、VBA、SQL Server Query；精通多因子建模和因子挖掘；熟悉各类数据库（Wind、Gildata、Datayes、Gogoal、Bloomberg、Reuters、Factset等）；熟练使用Git等代码管理工具。