

李广麒

电话: 18701768505 | 邮箱: lgq@udel.edu



教育背景

西南财经大学，金融数学专业（金融服务与量化交易方向），大四 2021.09-2025.06

GPA: 4.2/5.0; 专业排名: 2/55

专业课程: 机器学习与商业应用(100), 概率论(99), 数理统计(97), 高等代数 II (97), 金融随机分析 (97), 数学建模与数学实验(97), 优化理论与应用(99), 常微分方程(92), 会计学 II (99), 投资学(100), 货币金融学(97), 金融数据量化分析(94)

荣誉奖项: 全国大学生数学建模竞赛四川省一等奖、Kaggle Optiver 银牌、校三好学生、校乙等奖学金（专业top5%）

实习经历

国泰君安，金融工程组实习生 2024.01-2024.04

- 设计并实施Smart Beta策略，选用特定因子（红利、低波、价值、成长、动量、规模）与中证全指进行对比分析。通过数据清洗和因子优化（包括异常值处理、标准化处理和行业市值中性化），成功构建多空组合，实现年化收益率超出市场基准5%；
- 实施基于中信医药行业龙头的选股策略，利用Fama-Macbeth回归法构建多因子模型。通过集成宏观经济指标的因子化，并结合财务指标优化因子选择。使用年末数据点来进行模型回测和性能分析，通过日历效应修正后的分层效应检验，显著提升模型的预测精度和稳健性。

信达证券，金融工程组实习生 2023.07-2023.11

- 开发基于风险预算模型的大类资产配置回测框架，利用pandas、NumPy及其SciPy动态匹配资产权重，以符合目标风险水平。通过风险贡献的计算和优化，实现了年化收益率5.92%、年化波动率2.45%，并将最大回撤控制在5.80%；
- 构建并实施多因子模型滚动训练与回测框架，结合单因子检测框架，通过构建基本面和量价因子，结合自定义与内置算子如MA、STD、PCT_CHANGE等进行因子生成，应用IC序列相关性统计和VIF检验处理因子间的多重共线性问题，合成综合因子。

华创证券研究所，计算机组行业研究实习生 2023.04-2023.07

- 独立撰写针对计算机行业上市公司的财务简报，分析其财务表现和业务进展，支持股票池的动态调整和投资建议；
- 对科大讯飞采购订单数据进行统计分析和可视化处理，使用Tableau绘制趋势图和区域热图，揭示地区市场动态和产品销售趋势，为公司市场战略提供定量支持。

科研&实践经历

基于机器学习与遥感影像数据进行信用风险评估：消费贷款的空间分析研究 2023.07-至今

- 选取美国P2P消费贷款数据（Lending Club）作为样本，以AUC作为违约问题二分类度量指标，利用ArcGis Pro从3位zip code层面的卫星图像提取空间图像因子引入模型，探讨空间信息在不同模型上对信贷模型的提升效果以及与宏观经济变量进行对比和协同效应的研究，同时探究空间因子在时间层面的累计效应；
- 发现空间因子在不同机器学习模型下（XGBoost、CatBoost、LightGBM）在测度指标上均有明显提升。相比于宏观经济变量，空间因子在提升信贷模型预测效果上表现得更为显著。

基于 DE-SHAP-LightGBM 模型提高客户复购金融产品预测精度的研究 2023.11-2024.06

- 基于LightGBM模型，使用focal-loss采用DE差分优化算法进行超参数优化，结合SHAP分析进行特征衍生，同时对准确率、回撤率等基于双分类问题的指标进行改进，研究模型对样本不平衡情况下的客户复购金融产品三分类预测精度提升；
- 利用此算法的可解释性，说明客户在最近 180 天的交易次数与两次购买最小间隔等因子对复购金融产品预测精度提升较大，为商业银行识别活跃客户通过了政策建议。

金融工程与智能金融课题，基于大数据和机器学习的金融量化投资分析与研究 2023.01-2023.04

- 利用TensorFlow构建多层长短期记忆网络（LSTM）进行股价预测，结合协方差缩减技术结合均值方差优化（MVO）模型，使用历史股价数据作为输入，识别股价时间序列中的长期依赖关系。通过蒙特卡洛模拟动态优化投资组合权重，减少估计误差，提高预测的准确性和投资组合的风险调整后的回报；

- 独立撰写论文并被收录至ICMRED 2023；Li Guangqi, the first author, Enhancing Portfolio Performances through LSTM and Covariance Shrinkage, (Paper ID: ICMRED_0569)。

西南财经大学，金融建模协会，协会会长2021.10-2024.06

- 参与2022年四川省大学生金融科技建模大赛，对调用随机森林、XGBoost等机器学习模型有实践经验；
- 参与协会Python编程内训，深入学习Numpy与Pandas等数据分析库，有数据清洗、特征工程相关能力与经验。

技能爱好

语言：托福101；英语可作为工作语言

技能：熟练使用Python（包含Numpy、Pandas、机器学习）、ArcGIS Pro、RiceQuant平台、MySQL、Wind DataBase

爱好：音乐、摄影