**吕丽颖**

地址：美国99 Florence St Apt 214, Malden, MA02148,USA

联系电话: 001-8573335164（美国） 86-15201928352(中国) Email:stellalylu@163.com lylu@brandeis.edu

**教育背景**

**2013.08-2015.05 美国布兰迪斯大学(美国综排31位) 商学院 金融学硕士(金融工程方向) GPA:3.86/4.0**

* 课程:金融建模, 计算机模拟建模, 经济预测建模, 期权&衍生品, 固收,技术分析,交易,估值,风控, 组合管理
* 荣誉奖项：由商学院院长授予的年度杰出学生荣誉称号、2015届杰出毕业生荣誉称号

**2009.09-2013.06 复旦大学经济学院 世界经济系 经济学学士 GPA:3.51/4.0**

* 课程包括计量经济学、博弈论、投资学、VB编程、宏微观经济学、国际金融、货币银行学、跨国策略等
* 连续三次荣获复旦大学奖学金，连续三年分别获得校优秀学生，校优秀团员，校优秀学生干部等荣誉称号

**2011.07-2011.08 华盛顿圣路易斯大学(美国综排12位) 学术交流项目 GPA:3.85/4.0**

* 奖学金：以总分第一获得华盛顿圣路易斯大学短期项目奖学金（4000美元）

**实习工作**

**2015.07-至今 Mass PRIM投资管理 - 对冲基金与低波动策略 美国波士顿 量化对冲分析员**

* 使用Matlab和VBA构建量化模型, 结合Barra工具,基于回报率对现有资产组合进行beta分析, 因素和策略包括价值、成长、市值规模、动量、加速、相关系数、价格/交易量波动、市场情绪、宏观因子、市场区域等
* 参与投资方案与投资策略的选择决策讨论, 参与基金经理的会谈, 探讨资产组合的构建,探索潜在投资机会

**2014.07-2014.08 中银国际证券研究部暑期实习 上海 医药行研实习生**

* 撰写完成海南海药深度调研报告，包括概况/收入利润构成与增长/主要业务分析/研发/销售体系/估值/风险
* 完成2014下半年医药投资策略报告，包括行业运行概况/估值水平/热点事件/政策动态/投资逻辑/个股推荐
* 从事以下专题的行业研究：中国医保体系发展、社会资本参与民营医院、沪港通医药板块等

**2014.06-2014.06 中信证券研究部 上海 建材行研实习生**

* 协助撰写完成沪港通水泥行业的专题报告，内容涵盖政策脉络/超额收益与溢价分析/估值分析
* 对水泥行业拉豪并购案例进行全面深入的分析，并撰写分析其对国内水泥行业发展的启示意义
* 通过Wind、Bloomberg等软件搜集水泥行业资料数据，撰写5、6月份水泥行业数据点评报告

**2013.12-2014.02 泰博资本投资管理（美国） 美国波士顿地区 医药行研助理分析师实习生**

* 跟踪美国生物医药行业动态，分析行业趋势和个股公司策略，协助撰写美股医药行业周报
* 撰写发布个股分析报告（CELG和BMY两家医药公司），包括深入财报分析与多种模型估值

**2012.07-2012.10 花旗银行 上海 消费金融业务实习生**

* 结合各类金融衍生产品的特性，为目标人群提供14种金融理财产品的选择及资产配置的建议
* 利用基本面信息和技术分析研究外汇市场表现，为EYA和PA两种外汇产品交易策略提供支持

**2012.01-2012.05 东亚银行总行财富管理部 上海 财富管理实习生**

* 用VBA编程开发与彭博终端相关联的excel模型以监测和评估SIA结构性产品及其他衍生产品的市场表现
* 利用彭博分析市场动态, 制作金融市场周报，提供数据分析及数据可视化，为产品发行提供市场观点研究

**活动经历**

**2015.01-2015.02 基于MATLAB对亚式期权(Asian Option)的风险建模与极端损失分析 团队负责人**

* 根据亚式期权的特殊路径依赖结构, 与普通期权进行对比, 通过MATLAB设计代码进行建模,分析极端损失
* 假设不同分布(正态分布\T分布\帕累托分布), 区分不同历史时段,区分不同的市场(美国标普\上海上证\日经)

**2014.01-2014.05 投资组合管理挑战赛（模拟基金） 模拟基金团队负责人**

* 自上而下，建立量化分析模型，结合基本面分析筛选个股，并通过财务金融建模与蒙特卡洛模拟构建权重
* 追踪与评估组合绩效，择时调整仓位，并阶段性报告与展示

**2013.09-2014.01 OANDA平台模拟外汇交易 模拟交易员**

* 通过技术分析(基于HSI\MACD等指标)结合消息面，对外汇模拟交易，获得20%收益(50名选手中排名第4)

**2013.10-2013.12 高频交易对中国股票市场的可行性与适用性分析 分析员**

* 从交易机制、交易费用、法规、流动性以及高频交易自身特性角度评估高频交易适用性

**2011.09-2012.06 复旦大学经济学院学生会 实践部部长**

* 部门规模共72人。负责构建复旦学生社会实践科创平台，审核并统筹答辩，筹集项目经费（共26000元）

**2011.08-2012.08 复旦大学复旦学院 助理辅导员**

* 管理策划班级事务，组织开展学生活动，为新生提供各类咨询，指导生涯规划

**技能证书**

专业类 已通过CFA三级(全部级别)、FRM二级(全部级别)、并已通过四门证券从业资格考试（基础、基金、交易、投资）

语言 英语（TOEFL:106, CET-4: 618, CET-6: 593, GMAT:730）；日语（基础）

计算机类 通过全国计算机二级编程考试, 掌握MATLAB、SQL、VBA、GIT、STATA、R语言、Eviews、VB.NET编程、Prezi、MS office等软件/语言的使用, 以及熟练操作Bloomberg、Wind、Capital IQ等数据平台