**吕丽颖**

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

手机：001-8573335164（美国） 86-15201928352(中国) Email：stellalylu@163.com

**教育背景**

**2013.08-2015.05 布兰迪斯大学(美国排名31位) 金融学硕士(金融工程方向) GPA：3.86/4.00**

* 课程：计算机建模、金融预测建模、期权&衍生品、组合管理、固收、技术分析、交易、估值、风险管理
* 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 世界经济系 GPA：3.51/4.00**

* 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(美国排名12位) 短期学术交流（数学方向） GPA：3.85/4.00**

* 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）

**正式工作**

**2015.02至今 MassPRIM投资管理对冲基金团队 波士顿 量化研究员**

* **大类资产配置及择时模型的指标筛选和模型回测：**包括美股大盘、美股中小盘、EAFE市场、新兴市场以及利率市场指标和信用市场中的宏观、估值、情绪和动量四大类指标
* **多因子选股模型的构建、优化及回测：**Enter、Combo5、PCA、Stepwise、Stagewise、LAR及Lasso等多个模型
* **Alpha策略构建：**参与资产品种的筛选及组合构建管理，包括多空市场中性、Short Extension策略及Short Bias策略
* **Beta策略构建：**参与Smart Beta策略组的开发和构建，包括低beta、Carry、Value、Momentum、Quality、Size等因子在不同资产品种中的捕捉，以及将期权组合策略用于捕捉波动率溢价的可行性提案
* 参与基金经理同业交流，完成市场优秀策略的复制和模拟，负责风控管理、组合业绩评估与归因等日常性工作
* 日常工作涉及到的相关工具包括：Matlab、SQL、Git、VBA、Stata、R、Python、Barra、Bloomberg等

**实习经历**

**2014.07-2014.09 中银国际证券研究部 上海 暑期实习生**

* 完成一篇个股深度调研分析报告(海南海药)，涉及业务/研发等基本面分析，以及收入利润预测及模型估值
* 完成一篇策略报告(2014下半年医药投资)，包括运行概况/估值水平/热点及政策动态/投资逻辑/个股推荐等
* 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

**2014.04-2014.06 中信证券研究部 上海 建材组实习生**

* 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与多种估值分析
* 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并购发展的启示意义

**2012.01-2012.05 东亚银行上海总部 上海 财富管理部**

* 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
* 进行阶段性金融市场回顾及数据可视化, 结合消息面、基本面和技术分析，为理财产品发行提供支持与参考

**实践活动**

**2014.01-2014.06 投资组合模拟挑战赛 团队负责人**

* 自上而下**精选个股**，首先通过行业轮转指标与相关系数矩阵分析筛选行业，然后通过详尽的基本面分析筛选个股，最后通过Bootstraping与蒙特卡洛模拟构建权重的同时**做空股指期货**实现市场中性获取稳定超额收益
* 利用动量与估值指标的结合**构建择时模型**调整仓位，在赛程6个月中获得持续稳定的正收益，SR=1.3

**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 项目负责人**

* 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在中国市场适用性

**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）

**技能证书**

* 专业类 已通过**CFA三级、FRM二级**考试，通过四门证券从业资格考试（基础、基金、交易、投资）
* 外语类 GMAT：730；托福成绩 106；英语六级 593（优秀）；英语四级 618（优秀）
* 计算机类 Matlab、Python、SQL、VBA、Git、Stata、R、Bloomberg、Wind、Barra、Capital IQ等