**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, 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,风控
* 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) 短期学术交流(数学) 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）

**工作经历与实习经历**

**2015.02-至今 MassPRIM投资管理对冲基金团队 美国波士顿 量化分析员**

* 独立负责多因子模型的设计、开发、优化、编程与回测; 主要涉及的模型包括: Enter模型,Combo5模型,PCA模型,Stepwise模型,Stagewise模型,LAR及Lasso模型; 应用工具包括:Matlab,SQL,Git,VBA,Barra等;
* Alpha构建: 基于多因子模型参与负责证券与基金的筛选以及组合构建管理,主要策略模型有:多空市场中性策略,Short Extension策略,Short Bias策略以及FOF与MOM的基金投资管理形式.
* Beta构建:合作负责SmartBeta策略组的开发和构建,包括低beta, Carry,Value,Momentum,Quality,Size等因子在不同种资产类型中的捕捉,以及将期权组合策略用于捕捉隐藏波动率溢价的可行性提案.
* 合作参与Repolicate Activist策略组合的设计与构建,以及定期的仓位调整;
* 协助参与宏观大类资产配置与择时模型的指标筛选和模型回测, 指标包括美股大盘,美股中小盘,EAFE市场,新兴市场,以及利率市场和信用市场中的宏观,估值,情绪,动量四大类指标.
* 协助负责 风险监控与管理, 投资组合的业绩评估与归因等周期性工作.

**2014.07-2014.08 中银国际证券研究部 上海 医药行研暑期实习项目**

* 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

**2014.06-2014.06 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

**2013.12-2014.02 泰博资本投资管理 美国波士顿地区 医药行业分析助理**

* 参与美股医药行业研究,涉及行业趋势,重要影响因子以及前景动态,结合SWOT以及波特五力模型等使用
* 完成两篇个股深度分析报告（CELG和BMY两家医药公司），包括深入的财报分析及用多种模型的证券估值

**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
* 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

**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编程进行建模,分析极端损失情况
* 分别设定不同分布(正态分布\T分布\帕累托分布),不同历史时段,以及不同的市场(美国标普\上海上证\日经)

**2014.01-2014.06 投资组合管理挑战赛 模拟基金团队负责人**

* 自上而下,通过行业轮转指标与相关系数矩阵分析筛选行业,并通过详尽的基本面分析筛选个股，通过Bootstraping与蒙特卡洛模拟构建权重, 同时做空股指期货实现市场中性获取绝对稳定收益.
* 后期基于动量指标与价值指标的结合信号择时调整仓位，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 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(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）；普通话等级测试二级甲等;

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、Barra、Capital IQ等数据平台