

# 李楷

19102860593 (微信同号) | likaiwork569@163.com  
个人实习答辩、项目展示: <https://nanyong.github.io>  
中共预备党员  
2022届在职 | 深圳、上海 | 金融投资研究类岗位



## 教育经历

- 西南财经大学 (保研)** 2019年09月 - 2022年06月  
金融学 (金融科技) 硕士 成都市  
● 四川省大学生综合素质A级证书; 校三好学生; 校一、二等奖学金; 校“优秀研究生”奖学金; 研究生学术节二等奖
- 东北财经大学** 2015年09月 - 2019年06月  
电子商务、金融学双学位 本科 大连市  
● 校一、二等综合奖学金共计三次; 优秀共青团员; 社会公益行为先进个人; GPA前10%获得保研资格

## 工作与实习经历

- 安信证券股份有限公司** 2022年07月 - 至今  
全职 基金投顾组 金融产品部 深圳市  
因公司架构调整, 毕业入职前被告知, 校招收到的种子基金业务岗的校园招聘录用, 调整为入职总部基金投顾业务岗。
- 安信证券股份有限公司** 2021年04月 - 2022年06月  
实习 FOF投资助理研究员 种子基金业务部 上海市  
● 累计实习十个月, 自主python实现每周自动化输出PDF、表格、WORD等子基金研究报告涉及区间绩效指标以及经正态分布转换打分排名、线性拟合识别“画线派”、BARRA风格打标签、FAMA五因子模型风格归因。  
● 蒙特卡洛模拟生成产品净值、曲线净值分布, 期望收益所预计时间等, 写入基金投顾报告中; 风险平价模型的学习与使用。  
● 参与私募基金管理人尽调、回访, 撰写会议纪要。撰写种子基金上会材料, 涉及管理人代表性产品的绩效排名计算, 管理人背景描述, 合规分析, 准入判断, 评审意见, 预计收益测算。
- 融通基金管理有限公司** 2021年08月 - 2021年11月  
实习 产品经理助理 战略与产品开发部 上海市  
使用SQL数据库根据可转债溢价类型合并权益仓位对公募二级债基进行固收+基金的定义分类并自动输出表格; 基金市场战略分析, 如对天天基金组合宝进行产品收益风险类型特点分析、协助撰写两万字公募基金互联网金融报告。
- 交银理财有限责任公司** 2021年07月 - 2021年08月  
实习 投资助理 固定收益部 上海市  
协助完成27个投资组合的明细及产品申赎的日常台账统计; 跟踪固收+类组合的规模、收益、回撤水平。协助FOF投资决策: 复现宏观大类指标历史趋势的绘图统计; 第三方平台市场基金投顾信息统计; 协助路演PPT报告制作。
- 华西证券股份有限公司** 2020年07月 - 2020年08月  
实习 自营交易助理 固定收益部 深圳市  
填报每日资金、现券交易单、核对销售交易头寸; 计算销售交易的逆回购盈亏情况; 核对货币中介机构费用单; 汇总统计每日标准券折算率、新发企业债及公司债。撰写会议纪要; 完成会议PPT报告制作、其他材料的填报。
- 中国银联股份有限公司** 2019年06月 - 2019年08月  
实习 银行服务代表助理 机构合作部北京团队 北京市  
协助银行服务代表完成银联卡发行、支付结算的数据分析报告, PPT制作; 竞品分析。爬虫收集、归纳、筛选已发行信用卡特色营销活动信息, 制作相应数据透视表。协助费用凭证、材料归档等综合室日常事务。

## 技能/证书及其他

- **证书/执照**: 金融风险管理师 (FRM) 二级、特许金融分析师 (CFA) 一级、基金从业、证券从业、计算机二级C
- **语言**: 英语 (CET-4): 546、英语 (CET-6): 540
- **技能**: Python、Matlab、Eviews、SPSS、MySQL、Office办公软件, Wind
- **活动**: 曾任组织委员、院团委干事。“星海论坛”学术会议、中国航海博物馆、“关爱温江特殊儿童”等志愿者

## 竞赛经历

- 四川省大学生金融科技建模大赛** 2020年10月 - 2020年11月  
基于新网银行提供用户的特征和行为面板数据, 运用统计机器学习算法完成信贷违约预测 省级一等奖  
● 个人赛制, 独立完成数据预处理、特征构造, 使用LightGBM模型完成任务, 最终排名24/1500
- 美国大学生数学建模竞赛 (MCM/ICM) 国际二等奖 (H)** 2018年03月 - 2018年03月  
● 问题E: “气候变化如何影响地区不稳定性” 负责使用MATLAB、SPSS完成聚类、预测、绘图等任务, 部分翻译写作
- 第十三届挑战杯辽宁省大学生课外学术科技作品竞赛 省级三等奖** 2017年05月 - 2017年06月  
● 比赛负责人、论文一作, 框架构思、爬虫软件收集招聘信息、计算三种读研路径的收益成本结果、撰写论文
- 大学生创新创业项目训练计划项目国家级结项 获经费支持8000元 项目负责人** 2016年04月 - 2017年06月  
● 使用Unity3D简单设计了VR形式下的社交平台界面原型, 并撰写了VR技术在2015年时市场应用情况的若干研究报告

## 研究经历

- 学术成果上, 硕士毕业论文:《基于 LightGBM 模型的股票型基金排名预测》创新之处在于将机器学习与基金的业绩归因模型、基金的绩效评价模型以及股票多因子模型相结合, 提出了如何在庞大的基金池中存优去劣, 筛选出未来绩优基金的解决方案。
- 本科期间曾发表论文: 独作《自费出国与国内进修硕士的货币成本收益分析》于《中国市场》、一作《互联网金融内在垄断特质的成因》于《全国流通经济》, 硕士期间撰写《基于情绪因子的多因子模型在A股市场的应用》获得西南财经大学研究生学术节二等奖。