

# 宋伟力

手机：(+86) 18571508282 · 邮箱：405113793@qq.com

## 教育背景

湖南大学	管理科学与工程博士	2023 年 9 月起
• 研究方向: 金融风险管理、信用管理		
澳大利亚国立大学	统计学硕士	2020 年 8 月-2022 年 12 月
• 相关课程: 时间序列分析, 高等统计学习, 统计机器学习, 贝叶斯数据分析, 随机过程, 随机建模等		
清华大学	统计与数据科学研修班	2018 年 9 月-2019 年 6 月
• 相关课程: 概率论, 统计计算, 统计推断, 多元统计分析, 线性回归分析		
华中师范大学	生物技术学士	2014 年 9 月 - 2018 年 7 月

## 实习经历

北京时代复兴投资管理有限公司	2022 年 6 月-2024 年 6 月
量化策略研究员	北京
• <b>实盘</b> : 从 2023 年 10 月 22 日至今 <b>独立管理</b> 了一个 500 指赠的小规模产品, 在没有高频底仓 T0 增强的前提下, 产品超额夏普领跑百亿私募同业	
• 截止至 2024 年 6 月 26 日, 实盘 8 个月时间, 相对 <b>中证 500 指数超额收益 19.45%</b> , <b>超额夏普 2.398</b> , <b>超额卡玛比率 4.018</b> , <b>年化超额收益 32.08%</b> , 在 <b>2024 年 2 月超额最大回撤在 7.98%</b> (作为对比, 头部百亿私募的 500 指赠产品, 平均年化超额在 15-20%, 在 2024 年 2 月量化股灾超额回撤在 8-15%)	
• 基础工作: 搭建了日频、分钟频的量价数据采集系统; 搭建了舆情数据的采集系统; 建立了一套因子挖掘、因子筛选框架; 搭建了一套事件驱动的股票 <b>alpha</b> 策略回测框架; 建立了一套收益归因的框架; 初步完成了一套基于 <b>QMT</b> 的交易端用于实盘	
• 因子端: 基于强化学习和遗传算法对量价数据进行了因子挖掘, 对高频数据进行了低频化的 <b>alpha</b> 因子挖掘; 对于另类数据, 利用 <b>BERT</b> 文本情感分类模型、基于 <b>LLM</b> 构建了基于金融文本数据的的舆情因子和信号, 与量价模型信号的相关性不超过 0.1, 在 2023 年单舆情信号的超额在 10% 左右; 手动构建了 <b>Barra</b> 和其他风险因子用于风控端	
• 模型端: 2023 年在清华大学人工智能研究所所长刘洋的指导下, 对于量价数据基于 <b>LSTM</b> 和 <b>Transformer</b> 建模, 在模型端尝试了从不同角度下的优化, 使多模型融合后日频信号滚动回测的 <b>Rank-IC</b> 达到了 0.1, 投资组合回测对于沪深 300、中证 500 年化超额收益率提高到了 20%, 超额最大回撤控制在 3% 以内; 2024 年尝试了独特的 <b>combo</b> 方式, 进一步提升了因子 <b>combo</b> 后的效果	
• 风控端: 利用 <b>Gurobi</b> 在约束下对多模型融合后的选股结果进行组合优化, 控制了 <b>Barra</b> 风险因子上的暴露以及每日的换手率; 用整数优化来处理一千万以下小规模资金的组合优化问题	
北京鼎泰岩投资顾问有限公司	2022 年 2 月-2022 年 6 月
实习 量化策略研究员	北京
• 在数据方面、交易系统开发方面、股票 <b>alpha</b> 策略方面进行了一些入门级别的工作	

## 项目经历

Kaggle 比赛: 大语言模型科学问题考试大赛	88th / 2664(银牌)	2023 年 10 月
Kaggle 比赛: CommonLit-评估学生摘要能力大赛	23rd / 2064(银牌)	2023 年 10 月
第五届“UBIQUANT CHALLENGE”九坤量化联赛	6th / 532	2022 年 9 月-12 月
Kaggle 比赛: AMEX 预测美国运通信用违约	50th / 4874(Solo 银牌)	2022 年 5 月-8 月
Kaggle 比赛: 预测美国失业率的变化	1st / 65	2021 年 5 月

## 个人技能

语言: 英语 (流利, 雅思 7.0)  
证书: 基金从业资格证, 证券从业资格证