杨北锋

Tel：18201159007

E-mail: yangbeifeng@pku.edu.cn

Address:北京市海淀区颐和园路5号

**教育背景**

**北京大学 北京**

*专业：金融信息服务（软件与微电子学院）* 09/2016–07/2019

* **核心课程:** 金融工程概论、计量经济学、机器学习、金融数据分析、大数据

**西安交通大学 西安，陕西**

*主修专业：自动化（电子与信息工程学院）* 09/2009–07/2013

* **核心课程:** 控制原理、数字信号处理、数据挖掘、数据结构与算法

*辅修专业：金融学 （经济与金融学院）* 09/2010–02/2013

* **核心课程:** 西方经济学、金融市场、公司理财、投资学

**实习经历**

**银华基金 北京**

量化实习生，量化投资部 01/2018– 至今

* 利用Python研究方正证券金工研报《跟踪聪明钱：从分钟行情数据到选股因子》；

计算出基于量价的聪明度指标因子值，构建因子值和收益的收益预测模型，并做了行业中性和市值中性的处理，得到效果最好的因子值，对冲中证500指数得到Alpha收益；

* 利用Python对国泰君安研报《基于短周期价量特征的多因子选股体系》进行分钟线改造；

计算基于100G左右的分钟线行情数据191个因子值,使用多元回归构造因子收益预测模型，得到显著性因子，分析超额收益的交易量特征 ，后续加入机器学习的方法进行因子敏感性分析和模型效率的提升。

**鼎晖投资 北京**

量化实习生，润晖投资QFII基金south oak团队 07/2017– 01/2018

* 利用SQL Server和MongoDB工具完成股票、期货行情数据的存储和处理；
* 构建基于隐马尔可夫（HMM）模型的HS300股指择时策略；

根据模型设定关于大盘的牛熊状态，通过检验找到牛市状态的信号来实现Smart Beta；

* 利用MATLAB研究CTA策略，帮助团队完成对CTA策略的创建和研究，为后续的实盘交易打下基础；

包括ATR、布林线、Dual Thrust、R-Breaker等策略的研究。

**工作经历**

**上海大智慧股份有限公司**  **上海**

金融数据开发工程师, 数据产品中心 12/2013– 05/2015

* 主要利用数据库软件SQL SERVER和自动化任务软件AUTOMATION为机构客户定制个性化金融数据，开发和维护定制的金融数据库；
* 开发工具：SQL SERVER数据库，
* 开发和维护了中债登和泰康资产的定制数据库，根据定制要求创建或优化视图、存储过程等，完成各种金融数据个性化需求； 维护花旗银行、中国人寿的自动化数据需求等；

**招商证券**  **上海**

客户经理，上海翔殷路营业部 08/2013–11/2013

* 发展新客户,销售相关证券产品；提供和经纪业务有关的咨询、客户服务等。

**项目经历**

**数据模型课程项目** **北京**

**A股市场的多因子策略** 10/2016 – 12/2016

* 构建量化投资多因子模型，通过对历史数据的回测分析，找出收益率显著的因子，构建能够带来正阿尔法收益的投资组合；
* 分析沪深A股2010年至2016年的日行情数据，分别对估值因子、成长因子、财务质量因子、杠杆因子、动量因子等进行有效性检验，得出有效因子，根据打分法取得分前20%的股票构建投资组合。

**技能/兴趣**

**专业技能：** Python（精通）、SQL SERVER(精通)、MATLAB（精通）、Eviews（熟练）、C（了解）；

**证书/培训：**证券从业资格证、期货从业资格证、西安交通大学数学建模大赛二等奖。