

张源

电话: 13764478387

邮箱: alvinzhangyz@126.com

自我评价

拥有 10 年以上量化投研从业经验, 曾供职于多家百亿量化私募投资机构, 具备扎实的数学统计基础和丰富的金融科技实战经验。具备敏锐的市场洞察力和大数据算法分析敏感度, 能够快速识别风险点并制定有效的解决方案。注重团队协作, 具备良好的沟通表达能力和项目推进能力, 能够在快节奏的工作环境中高效完成任务。

工作经历

2022.11-2025.05

仲阳投资

量化基金经理

主要职责:

- 风控与模型体系构建:** 完成期货量化交易风控体系设计与实施, 构建涵盖市场风险、信用风险、操作风险的多维度风险评估模型。基于历史数据样本训练风险预测模型, 实现对 50+ 个商品期货品种的实时风险监控与预警。
- 特征工程与模型开发:** 负责多源异构数据整合, 构建包含分钟级、Level-1、Level-2 的多维度特征体系。运用 XGBoost、LightGBM 等机器学习算法进行模型训练与优化, 通过特征工程提升模型泛化能力和预测精度。
- 量化策略算法优化:** 设计并实现基于机器学习的量化交易策略, 结合 CVXPY 优化器开发投资组合管理算法。通过回测与样本外测试验证策略有效性, 建立策略绩效监控体系。

主要成果: 成功构建期货量化交易平台, 实现 35% 年化收益率, 最大回撤控制在 1.6% 以内, 夏普比率达到 5.9。策略模型在 5000 万本金规模下获得 14% 收益率, 佣金成本控制在 0.7bps 水平。

2020.03-2022.10

灵均投资

量化基金经理

主要职责:

- 风控建模与系统架构:** 基于 Level-1、Level-2 高频数据和多时间尺度切片数据, 开发动态风险预测算法, 建立订单级风控系统。通过集成机器学习技术, 实现对商品、股指、国债等品种的实时风险监控与仓位管控。
- 特征挖掘与模型构建:** 主持 AlphaSim 平台化因子挖掘项目, 运用时序分析与截面回归技术构建多维度特征库。采用集成学习方法融合 400+ 个量价因子, 通过正则化技术和交叉验证优化模型结构。建立因子有效性评估框架, 实现对弱信号的非线性建模与强因子的线性组合优化。
- 量化策略开发与优化:** 负责中低频量化策略的算法设计与实现, 基于多周期预测模型构建投资组合。运用深度学习技术挖掘市场微观结构特征, 开发 20+ 个机器学习策略模型。

主要成果: 负责 10 亿名义规模资管产品, 累计实现 2530 万总收益, 最大回撤控制在 400 万以内。构建的因子库规模达 400+ 个有效因子, 策略模型日均换手 15-25 倍, 为公司贡献稳定的绝对收益。

2016.03-2020.02

洛书投资

量化基金经理

主要职责:

- 数据建模与风控架构:** 构建跨市场数据整合平台, 融合场内 Level-1/2 数据、外盘联动数据及衍生品另类数据源。设计异构数据标准化处理流程。建立数据质量监控体系, 通过统计检验和机器学习方法识别异常数据。
- 量化模型研究与开发:** 负责中频日内量化策略的信号挖掘与模型构建, 采用时序分析与截面回归相结合的建模方法。运用梯度提升算法和神经网络技术, 通过交叉验证和样本外测试评估信号边际效力。
- 投资组合优化与执行:** 设计动态投资组合调仓算法, 基于风险平价和均值回归理论构建优化目标函数。集成订单路由系统与风险管理模块, 实现策略信号到交易执行的闭环管理。

主要成果: 管理 1 亿名义资金规模, 实现年化收益 30%, 最大回撤控制在 3% 以内。构建的多源数据整合平台支持跨市场策略开发, 为团队提供稳定的数据服务基础设施。

主要职责:

- 高频数据挖掘与分析:** 负责从 Tick 级高频数据中提取预测性特征, 构建覆盖能源、金属、农产品及利率期货的多维度特征库。运用时间序列分析和信号处理技术, 开发适用于不同预测周期的 Alpha 因子。通过机器学习算法评估因子有效性, 建立因子衰减监控体系, 确保特征在市场微观结构变化中的稳定性。
- 模型验证与风险评估:** 设计并实施策略模型的回测验证框架, 通过样本外测试和滚动窗口验证评估模型泛化能力。开发盘后分析工具, 集成统计检验和风险度量方法, 对策略绩效进行多维度评估。

主要成果: 构建跨品种特征因子库, 覆盖多个预测周期的 Alpha Profile 评估体系。开发的盘后分析工具显著提升了策略校准效率, 为团队量化研究提供了标准化的模型验证流程。

专业技能

- 风控建模与算法开发:** 熟悉 XGBoost、LightGBM 等机器学习算法, 具备信用评分、反欺诈模型开发经验。熟悉风控建模全流程, 包括特征工程、模型训练、评估调优、部署监控等。
- 大数据处理与特征挖掘:** 熟练使用 Python、Hive SQL、Spark、Coze 平台进行海量数据分析挖掘。具备多维度特征发现能力, 能够构建稳定的风控特征库并进行有效性验证。
- 模型部署与系统架构:** 具备 Linux 环境下模型部署经验, 熟悉 Shell 脚本编程。掌握 Redis、RabbitMQ、ZMQ 等中间件, 能够构建高效的实时风控系统架构。
- 项目管理与业务理解:** 具备金融科技领域项目管理经验, 熟悉银行、消费金融等业务场景。能够快速响应业务需求。

教育背景

2012.09-2013.06 波士顿大学 (美) 系统工程 (运筹) | 硕士

- 研究方向: 美国电力能源市场优化定价模型。
- GPA: 3.8/4.0, 获博士生全额奖学金。

2010.09-2012.06 西安交通大学 电气工程及其自动化 | 硕士

- 研究方向: 非线性电路系统建模, 发表 IEEE CS/PE SCI 论文 2 篇、IJBC SCI 论文 2 篇。
- GPA: 4.0/4.0, 专业排名: 1/80; 获国家奖学金。

2006.09-2010.06 西安交通大学 电气工程及其自动化 | 学士

- 研究方向: 非线性电路系统建模, 发表《物理学报》SCI 论文 1 篇。
- GPA: 3.9/4.0, 专业排名: 5/400; 获全国物理奥林匹克竞赛一等奖。

科研成果

- “Ripple-Based Analysis of Asymmetrical Subharmonic Instability in Grid-Connected Inverters”, *International Journal of Bifurcation and Chaos*, 2022.
- “Intermediate-Frequency Oscillation Behavior of One-Cycle Controlled SEPIC Power Factor Correction Converter via Floquet Multiplier Sensitivity Analysis”, *International Journal of Bifurcation and Chaos*, 2016.
- “Dimensionless Approach to Multi-Parametric Stability Analysis of Nonlinear Time-Periodic Systems: Theory and Its Applications to Switching Converters”, *IEEE Transactions on Circuits and Systems I*, 2013.
- “Distortion Behavior Analysis of General Pulse-Width Modulated Zeta PFC Converter Operating in Continuous Conduction Mode”, *IEEE Transactions on Power Electronics*, 2012.
- “单周期控制 Cuk 功率因数校正变换器中的中尺度不稳定现象分析”, *物理学报*, 2010.