



祝纪元  
金融学  
硕士研究生  
南科大量化实验室

182-7013-7363

xseeope@foxmail.com

Homepage: xseeope.github.io

LinkedIn: Jiyuan ZHU

## 教育背景

- 南方科技大学 2023-2025  
金融学硕士
- 南方科技大学 2019-2023  
经济学学士

## 项目经历

- 论文复现与改进: (Re-)Imag(in)ing Price Trends 2024.4  
Journal of Finance  
- 实验环境: CRSP, pytorch  
- 复现使用卷积神经网络的进行趋势模式识别的策略, 样本外 Sharpe 6.61, 并使用使用具有特征间的注意力机制的 ECA-net 进行改进, 季度策略提升超 30%.
- 深度学习统计套利 2024.7  
SUSTech Quant Lab  
- 工作概述: 使用线性多因子模型作为特定资产的 mimicking portfolio, 其残差项存在 mean reverting 的特性, 使用 CNN 学习残差序列的 local pattern, 使用 transformer 结合 CNN 学习到的局部特征与序列的全局特征; 实现方面, 使用微软 qlib 框架, 并在框架基础上扩展了 TSBatchsampler、MixedDataLoader, 实现时间序列采样与学术规范因子的构造与 load.
- 使用协方差深度网络的风险暴露估计 2024.4  
SUSTech Quant Lab  
- 工作概述: 利用卷积核的线性特性与线性因子定价模型的一致性, 使用非线性的方法估计风险暴露; 由于卷积层的输出维度随着公司特征个数线性增加 (斜率为 lookback window 的长度), 使用协方差池化方法对卷积层输出 (即残差序列) 进行降维的同时利用其二阶矩信息作为全链接层的输入, 使用下周期收益数据作为 label, 学习解释横截面上收益率差异的特征风险暴露.
- 指数增强策略实现 2024.1  
BARRA-type model  
- 工作概述: 使用市场、市值、动量、投资等 8 个特征, 并遵循 mean-variance 分析的二次效用函数, 构造对市值因子和市场因子风险暴露为 0 的自融资组合, 策略再平衡频率为月度。回测 1979 年至 2022 年的美国股票市场数据, 平均年化回报率超过 80 %, 平均年化 Sharpe ratio 为 2.4.
- 金融新闻分析系统 2023.11  
项目地址: <https://github.com/CHENGDU80/fintech80-codes-SUST-2023.git>  
- 概述: 包含一个完整的前后端和, 涵盖自己训练的文本情绪分析深度学习定量模型, 大模型文本分析功能, 热点事件追踪功能等, 帮助使用者挖掘金融文本中的信息。  
- 工程实现概述: 在工程上, 包含双后端, 基于 java springboot 和 sql 的后端存储股票与商品期货的基本信息 (量价信息等), python flask 后端用于实时获取来自 bing news api 与 tushare 新闻接口的文本数据, 定量深度学习模型、热点追踪功能与大模型文本分析功能也在本 python 后端中实现, 前端基于 vue2, 包含多个层级与板块, 支持收藏特定资产。

## 实习经历

- 国信期货有限责任公司 2022.11-2023.4  
投资部投资总监助理 深圳  
- 投研支持工作  
协助投资部投资总监的母基金配置工作, 对量化基金进行尽职调查, 着重考察量化对冲基金的可持续盈利能力; 协助投资部自营投资经理, 代表投资经理线下独立参加卖方研究机构组织的 TMT 策略分析师沙龙会。  
- 中台支持工作  
协助资产管理部 FOF 投资经理整理纪要, 协助路演、信息披露等工作; 作为主讲人在国信证券深圳分公司分享相关中台支持工作经验。

## 技术技能

语言成绩: CET6:558, IELTS:6.5

开发与分析工具: Python Java R stata

## 其他获奖情况

- 196 名 招行数字金融训练营数据赛道 2024
- Innovation Prize Fintech 80 Chengdu Hackathon 2023
- 二等奖 全国高中数学联合竞赛 2019