

# 王润天

电话: +8613651910330 | 邮箱:wrt990415@163.com | 微信号: wrt990415

## 教育背景

伦敦国王学院, 金融数学硕士 伦敦, 2022.09-2023.09

- 专业课程: 概率论, 风险中性定价, 金融市场, 利率和信用风险, 机器学习 (神经网络)

加州大学圣巴巴拉分校, 金融数学与统计学士 圣巴巴拉, 2017.09-2021.06

- GPA: 3.76/4.00 (专业 GPA: 3.86/4.00)
- 专业课程: 线性代数, 微分方程, 数值分析, 随机过程, 时间序列, 机器学习, 金融衍生产品定价, 资产组合优化

## 实习经验

天风证券研究所 | 食品饮料组 PTA 上海, 2021.08-2021.10

- 协助撰写年度投资策略报告并通过公共来源检索和收集数据; 通过人均 GDP 和人口结构等宏观因素以及产品种类、营销策略、收入和商业模式等公司特定因素, 对食品和饮料行业进行了自上而下的研究和分析;
- 识别中国整体行业周期以及酒类、乳制品、休闲食品等细分行业的周期, 分析市场领导者和成长型公司的业务绩效和财务历史以此预测他们未来的增长潜力和市场份额变化

兴业证券股份有限公司, 战略客户与协同创新部 | 实习生 上海, 2019.07-2019.08

- 了解券商各部门工作职责和各类基金、证券的基础知识, 阅读并学习兴业证券的 2018 年公司年度报告, 了解公司业务概要、经营状况、财务信息、股东情况、公司治理, 同时学习了年报中的排版格式以及如何确切使用图表帮助阅读;

## 实践工作

分析苹果股票周回报率与标普 500 指数周回报率的关系 圣巴巴拉, 2021.06

- 运用 python 计算最新 24 周的苹果股票周回报率与标普 500 指数周回报率, 根据得出数据构造多项式回归模型;
- 在 python 中运用高斯消元法求解回归模型中的正规方程组, 对满足条件的模型进行评估和筛选, 之后得到一个最优的 9 次方多项式, 并用此多项式对未来苹果股票周回报率进行预测

对苹果股票回望看跌期权定价 圣巴巴拉, 2021.06

- 在 R 中运用蒙特卡洛模拟根据布莱克-斯科尔斯模型模拟 90 个交易日苹果股票走势, 模拟 20000 次后得出预期定价以及定价的 95% 置信区间

在微软、国际商业机器公司、和星巴克三支股票中挑选投资组合 圣巴巴拉, 2021.05-2021.06

- 在 R 中运用三支股票的 6 个月数据估计各自的预期月回报率以及预期月波动性, 根据马科维茨投资组合理论在有效边界上挑选最小方差组合, 并根据资本资产定价模型挑选市场投资组合

运用时间序列分析并预测标普 500 指数 圣巴巴拉, 2020.12

- 使用 R 对 100 个标普 500 指数数据运用时间序列技巧拟合符合条件的 ARMA 模型, 在符合条件的模型中根据 AIC 信息准则, 诊断检验挑选出最优模型以用于预测未来标普 500 指数

运用机器学习分析美国大选的选民数据 圣巴巴拉, 2020.12

- 使用 R 对美国大选的选民的人口普查数据和各州总统候选人已有选票构造分类模型如决策树、逻辑回归和 KNN 等分析选民投票行为, 以及预测各州选票结果和最终结果, 比较 3 种模型的优缺点

兴业证券“未来领袖”训练营, 学员 上海, 2019.07

- 参加训练营举办的商业敏锐度沙盘课程, 模拟一家真实的公司的运作, 通过分析给定的市场环境、公司组织架构、资源配置、研发进度、预期成本与盈利等六部分做出策略决定以最大化盈利, 在 8 个竞赛小组中获得了第 2 名;
- 在沙盘课程成果展示中, 作为模拟公司的 CFO, 负责分析公司运营策略与运作成本, 反思决策中不足与成功之处

## 技能 / 其他

- 技能: Microsoft Office (精通), R (精通), Python (精通), latex (熟练), SQL (基础), C++ (基础)
- 证书: CFA 一级通过
- 语言: 普通话 (母语), 英语 (流利)