

顾浩天

邮箱: reper4ever@outlook.com | 电话: 13510188292 | 年龄: 23



教育背景

硕士 | 格拉斯哥大学 (亚当斯密商学院)

2022.09 - 2023.11

应用经济学 (金融建模与投资)

综合成绩: Merit (GPA: 4.0/4.0), 在校期间担任专业学生代表, 亚当斯密技能奖获得者, 在亚当斯密 300 周年经济挑战中取得团队第四名的成绩;

主修课程: 实证资产定价、投融资与资产价格、投资组合分析与投资、金融时序的建模与预测、国际金融与货币等。

学士 | 德蒙福特大学 (莱斯特古堡商学院)

2020.09 - 2022.08

金融学 (商务管理与金融)

综合成绩: First Class (GPA: 4.0/4.0), 在校期间担任过中国学联宣传部员和新生志愿者;

主修课程: 高级公司财务、商业研究与分析、金融计量经济学、国际金融衍生品、投资组合管理、风险管理等。

实习经历

世坤咨询 (北京) 有限公司

2023.09 - 2024.03

研究顾问

- 策略研究:** 借助数学模型对大量经济字段进行金融建模, 通过反复优化行业中性化、交易滞后等 Alpha 参数, 持续构建超 80 个多因子投资策略, 并全部通过 10 年 IS 测试期验证;
- 因子检测:** 运用特征工程, 数据挖掘, 时间序列分析等量化金融技术, 旨在发现市场中的微小但仍具掘利价值的经济字段, 对其处理并转化为可操作的投资策略, 累计进行超 680,000 次因子模拟实验;
- 专业学习:** 复现量化金融和金融工程领域的研究报告, 深入研究最新的量化处理技术和思维模式, 积极参与高水平顾问研讨会, 交流行业内的最新研究见解。

招商证券股份有限公司

2021.05 - 2021.07

客户经理

- 数据建模:** 研究复杂金融产品, 并深入理解专业经济概念, 将其运用于实际场景。利用 ARIMA, DCF 等模型对研究部推荐的股票进行预测和分析;
- 证券研究:** 积极参与公司每日晨会, 并深入参与基金路演、专家交流和策略研讨会等活动。撰写并整理会议纪要, 以确保信息沟通和传递的有效性;
- 投资教育:** 向合格投资者传授专业金融知识, 解析雪球等复杂金融产品, 协助其更深入地理解和应用投资策略。

科研经历

使用量子计算实现投资组合优化

2023.04 - 2024.01

论文作者

- 研究概述:** 使用二次无约束二值优化(QUBO)模型进行超额回报投资组合优化, 并提出了使用量子退火算法来寻找全局最优解。研究中对多种情况下的实际问题进行数学建模, 旨在找出适用于不同实际情况的最优算法;
- 研究成果:** EI 会议一作一篇, 研究强调了将 QUBO 模型应用于实际问题时的实际挑战, 为金融领域的超额回报投资组合优化问题提供了新的实证经验。

基于 ESG 指标的多因子增强选股策略

2022.09 - 2023.07

硕士毕业论文作者

- 策略构建:** 对 ESG 评级数据进行清洗、部分 Barra 风格中性化、因子衍生、根据 IR 值进行有效因子筛选、因子间相关性处理和因子合成, 并模拟真实市场回测。对比 ESG 评级因子与增强 ESG 因子, 传统因子在不同时间区间、行业及半衰期等方面的表现差异, 构建全面、可实盘的 ESG 投资策略;
- 研究成果:** 毕业论文成绩商学院第一, 同条件下增强 ESG 因子净值比 MSCI 的 CNE-5 模型提高 22.89%, 平均波动率降低 3.07%。

竞赛、技能及特长

相关竞赛: Mathorcup 个人二等奖, MCM (美赛) 团队荣誉奖

资格/证书: 证券从业资格, Bloomberg 市场概念 (BMC), Bloomberg ESG 证书

办公软件: MS Office, Bloomberg, Refinitiv

编程语言: Python, R, MATLAB

兴趣特长: 周易, 滑雪, 烹饪, 摄影

培训经历

JPMorgan Chase & Co.

2023.12 - 2024.03

量化研究工作模拟

- **时序建模:** 通过可视化、ADF 和 KPSS 方法对时间序列数据进行分析, 以确定其稳定性、趋势性和季节性。后使用经预处理的数据进行建模拟合, 以获得最佳的 SARIMAX 模型参数。通过自相关、偏自相关和残差正态概率分布的可视化, 对模型进行诊断与评估。最终将建立的模型用于预测未来的数据趋势和变化;
- **合约定价:** 为商品仓储合同创建了一个原型定价模型, 该模型经过进一步的验证和测试, 可以在获得相关参数后考虑到产品涉及的所有现金流, 向客户提供全自动报价;
- **信用风险:** 在对截面数据进行相关性检验和处理后, 采用朴素贝叶斯、神经网络等机器学习模型进行训练, 以预测违约概率及相关风险。使用对数似然、均方误差和 ROC 曲线等评估模型性能, 最终得出不同模型下的违约概率和预计违约损失。

个人陈述

多次参加或组织学生活动并担任专业学生代表, 拥有丰富领导与组织经验。本硕专业成绩均处于前 5%, 硕士毕业论文成绩商学院第一, 学习能力强, 热爱学术。具有丰富数学建模经验和较强的数据处理能力, 精通时间序列数据, 具有较强的专业能力。积极参加各类数学模型及金融竞赛并获得较前名次, 抗压能力较强, 团队合作意识强。两年家教经验, 亲和力强富有耐心, 具有良好的沟通能力。