

熊泽宇 (Hank), CFA, FRM

+86 15970624866, +1 6476210905 xiongzeyu1@outlook.com
在职, 考虑机会



个人总结

- 五年中国、北美金融科技行业从业经验
- 中英沟通流利, 具备团队合作管理经验与抗压能力
- 自我激励行动者, 终身在实践中学习者

技能/证书

- **办公软件**: Office, Bloomberg, Python, R, C++, SQL, Power BI
- **证书/执照**: 注册金融分析师 (CFA), 金融风险管理师 (FRM)
- **专业技能**: 资产分配, 投资组合管理, 风险管理, 销售, 路演, 量化研究, 分析报告

教育经历

多伦多大学 数理金融 硕士 数学院	2018.08 - 2019.08 多伦多
武汉大学 数理经济与数理金融 本科 经济与管理系	2014.09 - 2018.06 武汉
香港城市大学 经济与金融 本科 商学院	2017.09 - 2017.12 香港

工作经历

Picton Mahoney 资产管理公司 2021.07 - 至今
高级投资组合顾问 投资组合构造与咨询服务组 多伦多

- 在金融科技团队, 致力于将公司的投资组合构建框架、风险分析和科技整合并转化为个性化咨询服务和严谨统一的数字化平台
- 与客户和销售团队共同参与从了解客户需求、现有投资组合分析、到方案设计和额外审核的四步会议流程, 帮助客户诊断潜在风险, 设计更有可能实现其目标的投资组合, 同时促进公司产品销售
- 开发兼具机构级别且直观的多资产, 固定收益, 加拿大/美国股票风险因子模型, 与投资团队和销售团队合作迭代改进模型
- 基于模型, 通过压力测试和情景分析来给客户提供更全面的风险认知, 通过剥离系统性的风险因子溢价从而给客户提供更深入的经理量化尽职调查和主动管理价值增益
- 维护团队的数据和报告平台, 在供应商的软件开发工具包上开发多个自动化流程, 以进一步简化、自动化报告流程
- 与产品团队合作构造并维护加拿大最全面的流动性另类投资指数, 该指数旨在提高客户对流动性另类投资策略的认知并提供可参考的基准。除此之外, 还开发了多个工具来给销售团队更多交流材料和支持
- 与市场团队合作, 头脑风暴营销方式方法, 参与撰写多篇教育性内容和促销性内容文章

Canada Life 保险公司 2019.10 - 2021.07
高级量化分析师 商业风险部 多伦多

- 在传统金融公司的科技创新团队, 通过构造一系列自动化流程和数据分析为公司内部团队提供快捷经济的解决方案和服务
- 验证了一个利用保险条款信息和客户信息来预测合同是否会在不久后终止的统计模型, 构建的可选模型表现超过了基准性能, 检查了输入风险和模型输出风险, 并起草了核心模型的评审与优化建议给模型开发团队
- 通过自动化流程, 从公司多个域名中抓取5000+面向公众的PDF文件进行无障碍审查并生成表格文件用以给客户团队汇报
- 处理了数百万条应付账款数据, 实施了数十条规则以排序潜在欺诈可能性, 在Power BI中创建了应付账款欺诈监控仪表盘
- 验证了资产违约条款 (ADP) 模型, 原模型涉及参数校准和随机过程模拟, 编程复刻整个计算过程来检验一致性, 减少了80%的模拟时间, 并为开发团队和监管部门起草了执行摘要和技术报告
- 合作开发了用于预测保险顾问是否存在不当行径的统计模型, 重构了特征工程, 创建了高风险顾问的风险评分卡用于下游团队的审查
- 编写了Excel VBA脚本, 通过加密和解密手段来匹配不同区域团队的客户敏感信息交互

OPSEU 养老金信托 2019.01 - 2019.04
实习生 投资组合构造组 多伦多

- 利用市场及宏观指标, 开发了基于规则的投资模型框架, 用以动态地指导信用利差的资产择时。回测表明该模型能一致地产生更高的风险调整收益
- 利用全球多个宏观指标, 构造了一个全球熊市指标, 用以判断我们是否处于NBER经济衰退周期, 并协助构建了宏观经济和市场指标仪表盘以监控市场动态

龙胜投资管理有限公司 2018.04 - 2018.07
实习生 深圳

- 抓取清理期货的500毫秒快照数据, 检测巨额交易并可视化它与价格变换关系, 合作开发成交量加权平均价格交易算法
- 与开发部门协作开发设计投资组合表现风险评测和收益归因平台

聚润资本管理有限公司 2017.07 - 2017.08
实习生 北京

- 协助构造清理因子数据库, 对因子进行极值尾部分割和正交化处理, 回测因子IC值与模型选股择时表现