



復旦大學

李彤

1997.03.07 ◊ 男 ◊ 上海

(86) 159-0083-6626 ◊ rick.litong@foxmail.com

www.litong.tech



教育经历

复旦大学

硕士 金融科技 大数据学院

2019.09-2021.06

上海

- 成绩: 3.40/4 (40%), 复旦大学大数据学院优秀奖学金 (2021 年)、优秀新生奖学金 (2020 年);
- 主干课程: 机器学习, 神经网络, 数据挖掘, 大数据, 量化投资, 金融风险, 金融风险管理, 公司金融, 金融衍生工具, 投资学。

西安交通大学

学士 金融工程 经济与金融学院

2015.09-2019.06

西安

- 成绩: 3.41/4(40%);
- 主干课程: 量化交易, 固定收益证券, 金融工程, 宏观经济学, 微观经济学, 计量经济学, 时间序列分析, 高等数学, 会计学, 财务管理, 财政学, 国际贸易, 产业经济学, 金融大数据分析。

工作经历

浙商银行股份有限公司

金融市场部风险控制中心, 风险管理岗

2021.07-至今

上海

- 履行市场风险监测及报告职能。执行部门市场风险限额的监测、报告及突破限额的处置; 负责监控各项资金交易业务价格偏离情况;
- 负责新产品的市场风险识别。审核新产品的估值数据及模型、风险因子识别、风险监测方式及极端风险管控措施等;
- 配合推进 FICC 各项业务数字化改革。牵头完成保证金划拨流程电子化需求、债券及交易对手管理模块需求和授信管理模块需求, 并作为主要测试人员保障需求投产;
- 负责管理 FICC 资金交易系统。协助完成资金交易系统的新功能测试及投产, 熟悉利率、汇率及贵金属各项产品的业务逻辑和操作规程;
- 负责信用债券投后管理。推动交易类授信投后管理体系的优化, 对主体、区域、行业风险开展系统研究。掌握信用债及资产支持证券的研究及分析框架。

嘉实基金管理有限公司

风险管理部业绩分析组, 量化风控实习生

2020.11-2020.12

远程

- 资产组合成分研究。实现基于自编码器的组合成分权重推断模型, 通过在上证 50 指数和沪深 300 指数的实验验证了方法的可行性;
- 股债轮动研究。基于经济增长、货币政策、流动性、市场情绪等维度对股债滚动相关性进行分析并建立指标体系, 使用时间序列模型、机器学习算法等验证了股债轮动效应的影响因素。

平安银行股份有限公司

金融交易部债券与衍生品交易团队, 交易助理实习生

2020.07-2020.08

深圳

- 银行间资金面指标体系。构建银行间资金面指标体系, 并构建数据可视化面板。
- 数据爬虫及计量分析。使用爬虫从中债登、上清所、中国货币网等信息源获取托管量、回购余额等数据, 并基于格兰杰因果检验, 分析银行间市场券商杠杆率对于债券市场趋势的领先或滞后性。

广发基金管理有限公司

宏观策略部, 量化研究员

2019.07-2019.09

上海

- 宏观择时及风格轮动研究。从企业盈利、流动性、风险偏好三个维度构建市场择时打分体系, 结合当前估值水平进行风格指数配置。

研究经历

基于深度学习算法的沪铜期货投资策略研究

毕业论文, 基本面量化、商品期货

2021.02-2021.03

上海

- 基于基本面变量构建期货走势预测模型。从汇率、宏观经济、供需状况、价格水平等维度提取基本面指标, 结合计量模型检验和深度时间序列模型 (Attention-CNN-BiLSTM 模型) 探索变量对沪铜期货价格走势的预测能力。

专业技能

资质

证券从业资格, 基金从业资格, 大学生英语六级 (558)

Python

机器学习, 自然语言处理, 深度时间序列, 数据可视化及建模分析, 网络爬虫

数据库

MongoDB, MySQL, Neo4j

开发工具

Docker, Git, LaTeX