

# 牟两仪

CFA 持证人

手机号: +86 15902899196

邮箱: mu\_liangyi@163.com



## 个人陈述

作为曼彻斯特大学金融博士生和 CFA 持证人,我精通包括风险中性概率,市场微观结构,和最前沿的概率恢复理论等各种金融理论。具有指数期权,个股期权,以及外汇期权的丰富经验。熟悉各种常用数据库,包括 OptionMetrics, Bloomberg, Tomson Reuters DataScope, CRSP, DataStream, 以及万德数据库。善于多平台工作和利用各种软件优势,例如使用 Python 处理 tick 级别大数据,用 R 语言应用高级统计模型,通过 MATLAB 进行复杂数学计算等。

## 教育背景

### 曼彻斯特大学商学院

9/2017-至今

- ◇ 博士专业: 金融学
- ◇ 相关课程: 高级金融理论, 高级金融研究研讨, 实证公司金融等
- ◇ 研究课题: 期权隐含信息与高频数据
- ◇ 导师: Dr. Yoichi Otsubo, Prof. Alexandros Kostakis;
- ◇ 全额奖学金: Alliance Manchester Business School Doctoral Studentships;
- ◇ 课题第一章: Detecting political event risk in option market.
- ◇ 关键字: Political Event Risk, Option-Implied Information, Risk-Neutral Distribution, Implied Volatility Curve, Brexit Referendum.
- ◇ 课题第二章: Market Quality and Price Informativeness: Evidence from Extended Trading Hours.
- ◇ 关键字: Market Design; Liquidity; Extended Trading Hours; Asymmetric Information; Informed Trading; Predictability.
- ◇ 课题第三章: Beliefs and Preferences in the Option Market: Evidence from Climate Change Events.

### 兰卡斯特大学管理学院

10/2015-09/2016

- ◇ 硕士专业: 量化金融学
- ◇ 相关课程: 金融市场(81/100), 电子表格建模(71/100), 衍生品定价(80/100), 货币, 金融随机过程(76/100); 金融与经济应用统计方法(93/100); C++编程(91/100); 金融计量经济学(78/100)等
- ◇ 学位总评 Distinction;
- ◇ 2016 年作为本校学生代表兰卡斯特大学参加 2016 年 CFA 协会举办的股票研究比赛;
- ◇ 熟练使用多种软件(R, MATLAB, VBA)用于金融分析;
- ◇ 论文(优秀, Distinction): 为基于欧式期权的风险中性概率以及真实概率分析, 并且应用累积前景理论到真实概率分析。

### 东南大学 (985&211)

08/2008-06/2012

- ◇ 学士专业: 应用物理学
- ◇ 相关课程: 程序设计及算法语言(94/100, 95/100), 高等数学(83/100, 86/100), 现代经济学(87/100)等;
- ◇ 2009 年校三好学生;
- ◇ 雅思: 7 分

## 教学经历

### 助教 Alliance Manchester Business School

10/2018-至今

- 课程协助: 本科生暑期海外交换项目;

- 助教: 投资分析(2019, 2020); 公司金融和金融工具入门(2019, 2020); 金融工程(2020);
- 组织研讨会, 为学生提供辅导, 批改试卷, 制作网上教学材料。

## 学术报告

---

Detecting political event risk in option markets.

- Alliance Manchester Business School Doctoral Conference, May 2018; (英国)
- SoFiE Financial Econometrics Summer School (The Econometrics of Foreign Exchange Markets), Kellogg School of Management, Northwestern University, July 2019; (美国)
- SoFiE Financial Econometrics Summer School (The Econometrics of Derivatives Markets), New York University Shanghai, August 2019. (中国)

Market Quality and Price Informativeness: Evidence from Extended Trading Hours.

- 6th Young Finance Scholars Conference, University of Sussex, June 2019; (英国)
- Federal of Business Disciplines / Southwestern Finance Association Annual Meeting, San Antonio, March 2020; (美国)
- British Accounting and Finance Association Annual Conference, University of Southampton, Cancelled due to Covid-19, April 2020; (英国)
- European Financial Management Association (EFMA) conference, Cancelled due to Covid-19, June 2020. (爱尔兰)

## 实习经历

---

**上海牧鑫资产管理有限公司 量化策略分析师**

**10/2016-12/2016**

对各种不同量化择时策略进行测试分析, 比如双针突破, R-Breaker 和顾比均线。使用 MATLAB 对 10 年 A 股市场数据回测。

◇ 独立开发出一个新的量化策略。

从 2001 年到 2016 年在中证 500 成分股上应用该策略表明, 其回测效果远好于其参考指数。该策略的年化收益率为 49%, 最大回测率为 23%, 夏普比率为 218%。而同期指数的年化收益率为 19%, 最大回测率为 370%, 夏普比率为 19.5%。

## 工作经历

---

**上海牧鑫资产管理有限公司 量化策略分析师**

**1/2017-6/2017**

- ◇ 阅读研报, 使用 MATLAB, Python 和 WIND, 获取 A 股相关数据并清洗, 进行量化分析、构建投资策略并回测;
- ◇ 对策略进行各项指标分析, 归因分析, 风险分析, 参数敏感性分析;
- ◇ 建立周市场动态自动监控, 对市场资金、市场情绪、以及市场风格进行周频监控跟踪;
- ◇ 具有不同频率数据处理经验, 包括日频、小时、5 分钟、3 分钟数据;
- ◇ 对多种模型策略进行分析、改良, 例如 HMM、单项波动率、时间序列动量等;
- ◇ 精细化研究股票市场情况, 根据流动性实施不同程序化下单策略;
- ◇ 制作并维护股票多头策略监控下单程序以及动态净值监控程序, 确保下单指令与策略一致;
- ◇ 关注其他股票多头策略基金表现, 分析其采用的投资策略;
- ◇ 跟踪券商每周发布的投资建议, 并对其建议进行汇总分析;
- ◇ 为公司制定股票多头交易流程规范;
- ◇ 在公司内部对其他员工进行股票多头市场知识普及培训。

成就:

- ◇ 所开发的基于沪深 300 多因子选股择时策略在所管理期限内 (2017.4-2017.6) 获得累计收益 7.88%;
- ◇ 所在量化股票多头策略组资金管理规模超过一亿, 参与管理相关产品近 20 个。参与基金产品建仓, 调仓, 平仓全过程。

## **四川民泰置业有限公司 总经理助理**

**7/2012-7/2015**

- ◇ 定期分析宏观因素（货币，财政）和政府政策对房地产行业的影响。明确行业所处周期，并预测行业未来发展情况；
- ◇ 整理并对比分析行业其他公司，对当地房地产市场进行投资调查分析；
- ◇ 协助财务负责人处理公司财务运营相关事宜，协助税务规划，进行内部财务分析，定期向总经理汇报公司财务状况；
- ◇ 管理并配置公司流动资金，进行资本预算，管理融资事宜；
- ◇ 对公司项目开展财务与投资分析，预测现金流，分析盈亏平衡点等；
- ◇ 协助、审阅、检查法务部起草的文件、合同。整理并执行房地产行业相关法律法规；
- ◇ 协助公司总经理处理公司日常管理工作，管理各投资项目；
- ◇ 管理工程施工团队。

## **相关证书**

---

- ◇ **全国计算机等级考试（二级 C++） 2009**
- ◇ **会计从业资格证 2014**
- ◇ Chartered Financial Analyst (CFA) charterholder

## **擅长软件**

---

- ◇ **Python, C++, VBA, R, MATLAB, SAS, MS Office (Word, Excel, PowerPoint).**