

石长顺

✉ 734330866@qq.com · ☎ (+86) 18575560486



🎓 教育背景

厦门大学	王亚南经济研究院 (WISE)	金融硕士	2014/09-2017/06
主要课程：• 高级计量经济学 • 高级金融学 • 时间序列 • 固定收益 • 数据挖掘 • 大数据统计学 • 科研数据分析			
南开大学	经济学院	经济学 & 法学双学士学位	2009/09-2013/06

👤 工作经历

鹏华基金管理有限公司 监察稽核部 (金融工程师) 2018/5-至今

金融工程团队隶属于监察稽核部，主要为投研提供绩效归因服务，同时为管理层提供同业研究支持。

绩效归因工作：全面参与团队绩效归因数据及模型开发工作，覆盖权益、固收、QDII、FOF、另类等产品类型。

- 数据库建立及维护：参与建立包含内部各类产品的持仓、交易、损益等数据表的 Oracle 数据库，开发出 40 多个 Oracle 函数，可以输出资产配置、权益特征、固收特征、风险收益特征等近百个指标；
- 归因模型开发：参与开发 Brinson, Campisi 以及基于净值的基金归因模型；
- 成果输出：和开发人员共同开发绩效指标查询系统，通过投委会绩效报告、定期报告、专题报告等形式向公司内部及重要投资者输出成果。

基金经理画像：构建覆盖全市场公募主动权益基金的基金经理分析框架，服务内部领导同事。

- 数据库建设：建立包含基金基础信息、基金经理信息、获奖信息、基金资产配置、净值收益数据的数据库；
- 评价及归因：建立基于净值风险收益指标、Brinson 模型和多因子回归的绩效评价和归因框架；
- 基金经理标签化：建立估值风格、风险收益、行业主题、概念板块等大类的标签库；
- 可视化展示：使用 Python + Plotly + Dash 开发 Web 端交互式可视化应用。

同业战略研究：密切跟踪包括公募在内的大资管行业发展动态，为公司管理层提供咨询服务。

- 公募行业跟踪：跟踪公募行业各品类基金的规模变动、新发持营、资产配置、行业配置等动态；
- 基金金牛奖测算：2019 年中团队启动金牛奖测算工作，实现了公司奖和单产品奖项的复杂计算方法。利用规则建言献策，联动市场投研，助力公司 2011 年后再拿金牛基金公司。

其他工作：社保、年金、银行、保险等客户的绩效支持，人力考核计算支持。

第一创业证券股份有限公司 衍生产品部 (研究员) 2016/12-2018/5

第一创业证券衍生产品部为公司证券自营投资部门，同时进行场外期权、收益互换等业务。

场外期权业务：全面参与部门的场外期权业务，主要负责期权定价研究、询价回应、估值清算及风控等工作

- 定价研究：参与普通期权、障碍期权、二元期权及 Autocallable 期权 (凤凰期权) 等结构的定价研究；
- 询价回应：构建标的审查和期权定价交互页面并承担主要的报价工作，累计报价超过 1000 次；
- 风险监控及估值清算：日内期权希腊字母风险监控及盘后持仓合约估值，自动化生成每日业务报表。

量化策略研究：参与量化选股、择时、基金套利、期货期权等策略的实现、回测、绩效归因、可视化等工作

👨‍🎓 实习及项目

深圳凌云至善科技公司 (私募量化对冲基金) 策略开发实习生 2016/08-2016/11

- 参与 CTA 策略开发和回测、绩效评估、归因、可视化等工作。

WISER Club 负责人/培训师 2015/07-2016/09

- 在厦门大学联合创立 R 语言学习组织 WISER Club，并作为主讲人讲授多次专题培训；
- 在 WISER Club 主办的中国第九届 R 语言会议 (厦门) 研讨会，个人作“使用 R 获取金融数据”演讲。

📖 出版及论文

《银行间国债新券溢价度量——基于 Nelson-Siegel 模型》，第一届“中债估值杯”优秀奖，石长顺 2019/1

《中国经济转型》(第三版)，电子工业出版社，邹至庄 (著)，牛霖琳，徐晓云，石长顺 (译) 2017/9

《R 语言编程指南》，人民邮电出版社，任坤 (著)，王婷等 (译)，石长顺 (校) 2017/10

《知乎周刊·日常经济学》，浙江出版集团数字传媒有限公司，石长顺等 (著) 2014/2

🏆 技能及奖励

编程技能 Python: 熟悉, R 语言: 熟悉, SQL: 熟悉, WIND (包括底层数据库): 熟悉,

资格证书: • FRM • 证券从业资格证书 • 基金从业资格证书 • 期货从业资格证书

奖励: • 厦门大学 · 国家学业奖学金 (2015-2016) • 河南省三好学生 (2009/01)