



🎓 教育背景

伦敦国王学院 King's College London

2022.09 – 2024.11

复杂系统建模硕士, 数学系

雷丁大学 University of Reading

2018.09 – 2022.06

数学与应用数学学士

- 一等学位, 专业成绩 Top 10%。

🏆 竞赛经历

WorldQuant International Quant Championship 2024

全球 232 / 34,142, Top 0.6%, 英国第 5

- 对 Worldquant 平台的数据: A 股和美股量价, 基本面、舆情新闻, 波动率期权, 及另类数据等进行整理, 建模与分析, 挖掘多空策略 Alpha 因子。
- 使用截面工具与时序工具, 以及条件组合和风险控制工具, 在 IQC 2024 期间挖掘了 127 个有效因子 ALPHA 进入因子库。并通过 Sharpe、return 等 evaluation metrics 不断进行优化, 提升因子表现。
- 英国决赛线下前往 WorldQuant 与 Millennium 伦敦办公室提炼与总结研究历程, 进行 Alpha 展示, 开展有效沟通交流。与评委团队协同交流信号逻辑与风险判断, 提升改进。

WorldQuant MAPC 2024

全球第 11 / 850, 英国第 1

- 取用 Global Universe 的多维数据, 运用时序, 截面算子等进行 Alpha 信号挖掘, 累计挖掘 39 个低相关性的 Global Universe Alpha 因子, 获得了漂亮的 Alpha 组合表现。建立私有 repo PWOL (PENGYI WORLDQUANT) 进行因子与数据的逻辑内涵整理。建立 p-trading 等私有 repo 进行量化策略线上监控, 在不同细分条件下进行策略的运营优化。

💼 工作经历

平安银行

深圳, 2025.07 – 至今

- 管理培训生 (公司金融/零售金融/运营轮岗, 资金运营中心 FICC 交流, 年度绩效 TOP 10%);
- 协助梳理企业客户经营信息、行业资料与金融产品需求, 参与授信及业务材料准备, 覆盖新能源车与互联网生态, 跨境出海贸易等战略产业。提升 10% 部门事务处理效率。积极参与资金运营中心 FICC 相关交流, 研究 Fixed Income, 贵金属, 外汇的交易品种以及交易规则。
- 参与交易银行、跨境结算与现金管理等产品部门真实 workflow, 理解客户需求、建立客户画像, 参与产品方案、风险判断、审批协作与业务落地之间的完整链路。参与业务管理部行业研究, 并进行地区行业企业的批量检索与调查推送, 提升 5% 业务发展效率。
- 进行外汇交易策略的研究, 研究对手交易行为, 进行基于 L0,L1,L2,L3, OTC 数据的多方位策略研究。结合自身量化研究的经验, 进行 FICC 的品类研究以及开展相关 github project 的制作, 如私有 repo PFICC(PENGYI FICC, 专门进行 FICC 相关策略研究), 和公开 repo <https://github.com/pengpengyi92/rates-bond-quant>。

🔧 AI、数据与量化研究项目

AI Agent 与数据研究工程

AI agent 应用及研究, 2026

- 建立 PAT(PENGYI Agent Team) 从 RAG,Memory, tool use,planning, benchmark 五个方向进行前沿的 agentic 研究跟踪。为自己的 agent team 赋能。
- 建立 PPRT (PENGYI PULL REQUEST TEAM), 积极参与 github 社区的合作交流, 为开源项目如 Weknora, Nautilus Trader, Lightrag, Vibe-trading, nanobot,Openclaw 等持续做出开源贡献, 至今总共 merged 36 个 PR。
- 建立 PDAT(PENGYI DATA TEAM), 基于策略需求, 搜集数据资源, 逐步建立自己的数据系统:P-Trader 中的 DMS,Data Management System。并根据策略需求对数据进行清洗, 结构化处理, 管理数据质量。

PTFT: 趋势跟踪策略研究

上海慧衍私募商品期货研究学习项目衍生迭代为自有项目

- 基于日频 L0 数据做量价分析研究, 结合 orderbook L1,L2, trade L3 数据, 共同设置趋势信号。

PMMT 做市商策略研究与 ptrader

Positive Venture DAO 研究学习项目衍生迭代为自有项目

- 基于 L1, L2 orderbook 数据和 L3 逐笔成交数据, 梳理 mid price、spread、orderbook imbalance 和 trade-flow imbalance 等微观结构特征, 研究 fair price 的定价。结合库存要求, 研究双边 bid-ask 的合理报价。

🔧 技能与奖项

量化研究与工程: Alpha research, 数据清洗, 截面研究, 时序研究, 算子工具研究, 中性化, 回测评价, 信号诊断, 风险分析, 市场微观结构, 量化系统运营支持, 统计分析。

编程与数据: Python, Jupyter, Git / GitHub, Excel, LaTeX。

AI 研究与工程: LLM, RAG, Agent harness, AI Infra, experiment logging, Codex, Claude Code, memory 文件管理, agent team 建设, benchmark 研究, tool use, 规划与约束, AI 全栈开发, AI 协助数据分析与量化研究, 工程。

金融领域理解: 公司金融, 零售金融, 运营管理, 授信流程, 产业链金融, 互联网金融, 交易银行, 结算与现金管理, 跨境金融, FICC 研究, 外汇客户画像建立与管理。利率, 外汇, 及其衍生品。

语言: 中文 (母语), 英语 (IELTS 7.0, 可进行商务与学术沟通), 粤语。

其他奖项: 南京马拉松欢乐跑 7 公里第 10 名; 雷丁大学优秀毕业生奖 (Distinction);