

# 上海市金融信息技术研究重点实验室

## Shanghai Key Laboratory of Financial Information Technology

### 工作简报

No.2 2013.6

2013年7月5日

---

#### 目录

<b>科研动态</b>	<b>1</b>
校企联合申请课题获得上海市科委立项资助	1
<b>合作基地</b>	<b>2</b>
实验室与中金所技术公司商讨合作事宜	2
<b>平台建设</b>	<b>3</b>
实验室搭建“基于复杂事件处理技术（CEP）的综合程序化交易平台”	3
<b>学术论坛</b>	<b>4</b>
实验室一行4人参加“定量行为金融学短期班暨研讨会”	4

---

---

### 校企联合申请课题获得上海市科委立项资助

日前，上海市科学技术委员会 2013 年度“科技创新行动计划”信息技术领域项目评审结果发布，实验室与上海财安金融服务有限公司联合申请的课题《中小企业智能化网络融资平台的研发与应用》获得立项资助。

该课题包括两个子课题：《中小企业智能化网络融资平台的支撑技术及应用研究》和《中小企业网络融资产品匹配和风险控制》，分别由上海财安金融服务有限公司和实验室完成。

#### 课题简介：

课题名称：中小企业智能化网络融资平台的研发与应用

课题性质：“上海市科委科技创新行动计划”信息技术领域

课题时间：2013.7.1-2015.6.30

资助金额：140 万元

研究意义：作为经济社会发展的关键组成部分，中小企业在支持我国经济快速增长、解决劳动力就业和提升科技创新能力等方面，发挥着重要作用。然而，近年来随着中小企业的发展，其融资难问题也日益突出，中小企业融资市场具有巨大的潜在需求，但却长期无法得到满足。因此，本课题利用信息技术研究中小企业融资服务模式，打造智能化网络融资平台，以提高中小企业贷款融资效率和贷前贷后风险管理效率，提高金融中介的服务质量，对优化我国金融服务环境具有积极意义。

## 合作基地

---

### 实验室与中金所技术公司商讨合作事宜

2013年6月26日，实验室张超、任丽颖、闵敏、潘彦一行六人至上海金融期货信息技术有限公司（即中金所技术公司），就双方在合作研究和平台搭建两方面的工作进展与公司工程师郑永康、杨福祥和林惜斌博士进行讨论。

合作研究方面，双方围绕金融期货市场自动化交易问题提出以下三个课题：自动化交易监管政策研究、自动化交易策略研究、Span系统机理研究和原型系统构建。技术公司将就三个课题进行立项资助，其研究结果将支持“基于大数据技术的金融期货市场风险监控系統研究与应用”的项目研究。

平台搭建方面，中金所技术公司计划向实验室赠送多台服务器，作为自动化交易策略研究和原型系统构建的硬件支持。此外，双方还就沪深300指数仿真系统飞马的应用进行了商谈，确定实验室以会员身份连接仿真平台，以实现自动化交易策略的实现和仿真回测。上述平台搭建和应用都将为双方合作研究项目提供技术支撑。

### 合作基地建设背景：

2012年10月25日，实验室与上海金融期货信息技术有限公司（以下简称“公司”）在上海财经大学签订校企合作协议。为发挥高校与公司研究团队的资源优势，实现金融研究与应用紧密结合，推动金融期货行业的创新和发展，支持上海建设“国际金融中心”的发展需求，双方秉承自愿、平等、诚信、双赢的宗旨，共建产学研合作基地，在科学研究、人才培养、资源共享等方面开展校企合作。

## 平台建设

---

### 实验室搭建“基于复杂事件处理技术（CEP）的综合程序化交易平台”

为实现实验室的建设目标，成为上海市金融和信息化领域科学研究、社会服务和人才培养的重要基地。实验室正积极整合校内外资源，搭建“基于复杂事件处理技术（CEP）的综合程序化交易平台”。该平台将为程序化交易策略的研究论证、实现、仿真回测、执行、结果评估等环节提供技术支撑。

目前实验室正逐步搭建各类服务器环境，包括中金所飞马服务器、秦晖公司服务器和国泰安服务器等。其中，中金所已提供程序接口，实验室将可以会员身份连接仿真平台，进行策略回测。

针对量化投资交易策略的研究、设计和论证也在稳步进行中。对于研究论证阶段形成的量化策略，将进入策略实现阶段，依照 CEP 定义的开发架构体系完成对量化策略的开发实现。



### 实验室一行 4 人参加“定量行为金融学短期班暨研讨会”

2013 年 6 月 26—28 日，由华东师范大学风险管理与创新研究中心、华东师范大学商学院举办的“定量行为金融学短期班暨研讨会”在华东师范大学逸夫楼多功能厅召开，来自英国牛津大学、美国哥伦比亚大学、香港中文大学、香港理工大学、中国科学院、复旦大学、上海交通大学、上海财经大学、南京大学等国内外知名高校近 100 位专家学者、青年教师和博士研究生与会参加研讨。华东师范大学校长助理梅兵、商学院院长冯学钢以及国家千人计划学者周迅宇教授出席会议开幕式并致辞。

本次短期班暨研讨会提供了两套短期课程(每套 4 小时)以及一天的研讨会，实验室 3 位青年教师和 1 位博士研究生参与研讨会，期间对于行为金融学的研究领域有了深入的了解，也与参会的专家和青年学者进行了交流和沟通。



注：行为金融学经过三十多年的发展，已成为金融学的主流研究领域之一。其结合心理学理论着重研究人的情感和和心理偏差对个人投资行为及整体金融市场的影响，成功地解释了许多经典理论无法解释的悖论，以及泡沫、崩盘等非理性市场行为。近年来，数理金融、金融工程及风险管理领域的研究人员也开始对金融学产生浓厚的兴趣，他们致力于为行为金融学建立一个严格的、定量的理论基础，为行为金融学的研究注入更加科学的元素。