

# 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.3 2013.9

2013年9月30日

---

#### 目录

<b>科研动态</b>	<b>1</b>
2013年度实验室开放课题发布	1
2项“产学研”项目通过开题评审	2
<b>合作基地</b>	<b>3</b>
中金所技术公司与实验室建立联合研究测试环境	3
<b>产业互动</b>	<b>4</b>
实验室作为会员单位加盟上海大数据产业技术创新战略联盟	4
中诚信公司与实验室商谈合作事宜	6
<b>学术研讨</b>	<b>7</b>
改革、创新、风险管控——金融与资本市场健康发展高级研讨会顺利召开	7
实验室研究人员参加“风险管理与量化投资前沿”研讨会	8

---

#### 联系我们

网址：<http://fitl.sufe.edu.cn>

联系人：夏梦婕

联系地址：上海市国定路777号育衡楼318室

联系电话：(021) 65902786

邮政编码：200433

电子邮箱：[Hxia.mengjie@mail.shufe.edu.cn](mailto:Hxia.mengjie@mail.shufe.edu.cn)

### 2013 年度实验室开放课题发布

根据上海市科委对上海市重点实验室的建设要求，为服务金融行业需求、支撑多学科交叉研究，更好发挥实验室作为科学研究和社会服务基地的作用，实验室于 8 月发布 2013 年度开放课题指南，旨在使校内外相关研究人员依托实验室开展协同研究工作。

本次课题申报主要围绕金融风险管理、金融智能决策支持和金融产品创新三个研究方向；要求申请人须具备副高以上职称或博士学位；课题研究期限 1 年，资助经费为 2-3 万元人民币（具体根据课题情况确定）。课题申请人需根据要求提交申请书，由实验室组织专家进行评议，根据评议情况确定是否立项。

实验室希望，通过本次开放课题，聚集金融信息领域的研究人员开展更多合作，充分发挥基地的辐射作用。

更多具体信息可参见实验室官方网站：[www.fitl.sufe.edu.cn](http://www.fitl.sufe.edu.cn)

相关文件下载地址如下：

[2013 年度开放课题申请指南下载](#)

[开放课题申请表下载](#)

### 2项“产学研”项目通过开题评审

2013年9月3日，上海金融期货信息技术有限公司（即“中金所技术公司”）为上海市金融信息技术研究重点实验室申请的2个研究项目进行开题评审。

实验室常务副主任陈云教授，副主任谢斐，研究人员张超、任丽颖、姜广等一行前往中金所技术公司，就2个研究项目进行了项目开题汇报。

参与项目开题评审工作的专家评审组成员包括中金所交易部曾健，监察部佟伟民，技术中心鲁继东副总经理、唐兵、郑永康、林惜斌等多位中金所高层管理人员及领域专家。专家评审组对2个项目的研究内容和研究计划都表示肯定，同意立项，并就项目的后续工作提出了相关指导意见。

项目合作研究协议已于9月底签订。



实验室研究人员张超在进行项目开题汇报

## 合作基地

---

### 中金所技术公司与实验室建立联合研究测试环境

经过前期多次洽谈商讨，近日中金所技术公司与实验室正式设立联合研究实验测试环境。该实验测试环境主要应用于自动化交易策略研究和原型系统构建，为双方合作研究项目提供技术支撑；同时也是实验室云平台的基础设施，在服务器上搭建虚拟环境，用于各类数据库、云计算平台等。

由中金所方面提供的第一批硬件服务器已于 2013 年 8 月 28 日进入学校机房，目前实验室已完成调试工作。

#### 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优势，实现金融研究与应用的紧密结合，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。

### 实验室作为会员单位加盟上海大数据产业技术创新战略联盟

上海大数据产业技术创新战略联盟第一次会员大会于 2013 年 9 月 11 日在上海市科学会堂召开。上海产业技术研究院院长钮晓鸣、副院长石谦，上海市科委副总工程师陈东出席会议并为联盟成员单位授牌。近 50 家首批成员单位的企事业单位、高校和社会机构有关代表参加了会议。

会上，市科委发布了《“大数据三年行动计划”推进管理办法（试行稿）》，宣读了联盟首届理事会决议。联盟首批成员单位代表签署了联盟《共同协议书》。



上海大数据产业技术创新战略联盟第一次成员大会现场

上海大数据产业技术创新战略联盟由上海产业技术研究院等 19 家单位于 2013 年 8 月共同发起成立，其目的是搭建大数据技术创新及产业应用合作交流平台，建立互利共赢、共同发展合作关系。联盟的成立将更好地推进上海大数据相关产业链的完善，加快创新成果的转化和应用，引领上海智慧城市的建设和发展，使之早日进入“国家队”行列。

上海大数据产业技术创新战略联盟理事长、万达信息股份有限公司董事长史

一兵代表联盟表示，将依托联盟这个产学研用的创新平台，加强各单位间的产业合作，加速上海大数据相关产业的发展，提升上海的综合实力和核心竞争力。

本实验室常务副主任陈云教授、研究人员俞立参与了成员大会，了解了联盟的构成、推进管理办法、联盟协议内容等，并接受了大会的“成员单位”授牌。实验室作为上海大数据产业技术创新战略联盟成员单位之一，将为上海大数据产业技术的发展添砖加瓦，做出自己的贡献。



上海大数据产业技术创新战略联盟成员单位挂牌

### 中诚信公司与实验室商谈合作事宜

2013年9月11日，中诚信资讯科技有限公司总裁肖大平先生等一行来访实验室，与实验室常务副主任陈云教授进行了会面。

中诚信资讯科技有限公司，是国内著名信用评级机构“中国诚信”集团旗下全资子公司。其依托“中国诚信”在中国信用评级领域的领导地位和品牌形象，充分调动中诚信集团及长期积累的银行、券商、基金、上市公司等金融及相关领域合作伙伴的资源，以精准的数据、及时的资讯、先进的分析工具、有效的解决方案和优质的服务，推动中国金融信息服务业的发展，为金融机构、市场投资者提供全面、准确、及时的金融信息服务，在金融机构、金融产品、上市公司等的信用评级方面有着行业领先的优势。

结合实验室目前在中小企业信贷风险管理、金融创新产品风险控制等方面的研究课题，双方认为未来可在企业、金融机构、金融产品的信用评级领域展开合作研究，充分利用各自优势，在上述领域实现关键技术的突破和应用推广。

### “改革、创新、风险管控——金融与资本市场健康发展高级研讨会”

#### 顺利召开

2013年7月18日，由上海财经大学上海国际金融中心研究院（SIIFC）主办，我实验室和上海财经大学金融学院协办的“改革、创新、风险管控——金融与资本市场健康发展高级研讨会”在同德楼会议室顺利召开。实验室陈云常务副主任、张超、姜广、任丽颖等一行六人参与研讨会。

此次研讨会有多位业内专家出席并进行重要演讲，包括国家发改委投资研究所所长刘长春、中国投资咨询专业委员会会长刘慧勇、中央财办宏观组负责人景学成、上海证券交易所首席经济学家胡汝银、东方证券公司总裁金文忠、申银万国证券公司副总裁杜平、复旦大学国际金融系主任刘红忠教授、上海国际集团研究院副院长闻岳春、金浦产业投资基金懂事总经理范寅、东吴证券首席宏观分析师黄琳等。

多方专家、学者首先分别根据各自所在领域的前沿问题做了精彩的主题发言，然后又就我国资本市场、特别是金融市场现状和发展进行了热烈的讨论，对金融与资本市场的健康发展提出了诸多意见、建议。



研讨会现场

### 实验室研究人员参加“风险管理与量化投资前沿”研讨会

2013年9月12日下午，由中国量化投资协会举办的“风险管理与量化投资前沿”研讨会在浦东新区通茂大酒店六楼会议厅举行。来自浦东银行总行风险管理部、光大证券研究所金融工程研究部、恒泰期货公司及中国科技大学的数位专家分别就“国债期货与风险管理”、“金融文本挖掘系统理念及其投资应用”、“程序化交易及其前沿”、“基于机器学习和人工智能技术的建模方法”等内容作了报告。此外，银行、证券、期货、基金等机构的众多业内专家及个人投资者都参与了该次研讨会，并就如上问题进行了探讨与交流。

研讨会期间，实验室研究人员姜广、任丽颖等在“基于云计算的数据及文本挖掘技术在金融投资分析领域的应用”及“基于国债期货的套期保值策略在风险管理中的应用”等研究方向受到了深入的启发，对相关领域科学研究有了新的思路 and 想法。

注：中国量化投资学会是由量化投资领域的各方参与者们自发形成的民间非营利组织。学会的宗旨是推动量化投资与对冲基金研究在中国的发展。学会以学术活动为主要活动形式，以资源分享，思想碰撞为主要特征。中国量化投资学会目前在全国二十几个省市有分会，拥有会员 2400 多人，会员来自证券、期货、保险、银行、基金、私募、软件公司、管理咨询公司、投资公司等投资领域的各行业；学会已经成功在北京、上海、重庆、天津、深圳、广州等地开展十余场次学术活动。