

# 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.6 2014.4-6

2014年7月10日

#### 目录

<b>科研动态</b>	<b>1</b>
联合研究项目获上海市科委立项资助	1
《SPAN 系统风险矩阵计算参数设置方法研究及分析》项目通过开题评审	2
签署《大数据技术与应用丛书》出版合同	3
<b>合作交流</b>	<b>4</b>
与虹口区金融办洽谈合作建立上海对冲基金研究中心	4
申银万国期货有限公司来访洽谈合作事宜	5
申银万国证券有限公司来访洽谈联合培养博士后事宜	5
<b>学术交流</b>	<b>6</b>
2014 金融推进中国（上海）自由贸易试验区发展论坛	6
第二届亚洲定量金融会议（AQFC）	8
<b>开放活动</b>	<b>9</b>
2014 年上海科技周活动——重点实验室开放活动	9
<b>人才基地</b>	<b>10</b>
成功引进优秀研究人员和科研博士后	10
《2015 年研究生招生简章》发布	11

#### 联系我们

联系人: 夏梦婕      联系电话: 65902786      电子邮箱: [xia.mengjie@mail.shufe.edu.cn](mailto:xia.mengjie@mail.shufe.edu.cn)  
联系地址: 上海市武东路 100 号上海市金融信息技术研究重点实验室 201 室 (近学生中心)  
邮政编码: 200433      网址: <http://fitl.sufe.edu.cn>

### 联合研究项目获上海市科委“科技创新行动计划”立项资助

日前，实验室与上海金融期货信息技术有限公司（中金所技术公司）联合申报的项目《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》，获得上海市科学技术委员会 2014 年度“科技创新行动计划”立项资助。“科技创新行动计划”项目既注重关键技术攻关和引领，又注重技术成果的应用和转化。2014 年是上海“大数据三年行动计划”实施的第二年。该项目是大数据技术在金融、航运、医药等关键行业中的典型应用项目之一，也是今年科委首次在金融领域立项的大数据项目。通过本项目的研究，将在金融大数据领域进行深入探索和应用，具有典型的行业示范意义。

本项目中，中金所技术公司和实验室两方密切合作，各扬其长，无论在技术攻关还是成果转化等方面有望取得明显的突破。

#### 项目简介

项目名称：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

项目性质：上海市科委 2014 年度“科技创新行动计划”高新技术领域项目

项目时间：2014.7.1-2016.6.30

资助金额：200 万元（其中，子课题进校经费 165 万元）

研究意义：本项目针对我国金融期货市场面临的多产品监管、自动化交易等挑战，通过研究市场异常交易行为、自动化交易特征和影响，以及金融衍生品与期现货的关联特征，针对复杂事件处理、海量数据挖掘等核心技术进行攻关，构建具备实时监控和盘后分析的金融期货市场风险监控系統，并通过系統应用，有效保障金融期货市场平稳运行。

### 《SPAN 系统风险矩阵计算参数设置方法研究及分析》项目通过开题评审

2014年5月6日，上海金融期货信息技术有限公司（即“中金所技术公司”）为我实验室申请的研究项目《SPAN 系统风险矩阵计算参数设置方法研究及分析》进行开题评审。

实验室研究人员任丽颖等一行前往中金所技术公司，进行项目开题汇报。由中金所技术中心创新部部长郑永康领衔的专家评审组对该项目研究内容和研究计划表示了肯定，同意立项，并就项目的后续工作提出了相关指导意见。

该项目是《SPAN 保证金模型计算方法研究》（于2014年3月结项）的后续研究项目。SPAN 保证金系统是目前国际上最具代表性且技术含量最高的保证金系统之一。在SPAN 保证金系统操作过程中，参数设置是极其重要的一环，其正确性对保证金计算结果的有效性具有重要影响。新立项目将在前期项目研究基础上，融合当前风险管理领域内先进的风险计量模型及方法，研究SPAN 系统中决定计算精确性的关键变量设置方法。该研究将有助于我国衍生品交易所及监管机构在深入剖析国际金融衍生品市场的运作模式和风险管理基础上，探索适合我国金融市场的保证金控制体系，进一步提高国内期货交易所的国际竞争力。

### 签署《大数据技术与应用丛书》出版合同

2014年4月29日，由上海大数据产业技术创新战略联盟及上海市数据科学重点实验室联合策划的《大数据技术与应用丛书》出版签约仪式顺利召开。实验室常务副主任陈云教授作为《金融大数据》分册主编出席签约仪式，并与上海科学技术出版社签署出版合同。

《大数据技术与应用丛书》由上海大数据产业技术创新战略联盟及上海市数据科学重点实验室联合策划。第一批共有8册列入上海科学技术出版社的出版计划，分别为《金融大数据》、《城市交通大数据》、《智慧城市中的大数据应用之道》、《城市发展的数据逻辑》、《大数据：应用与测评技术》、《数据密集型计算和模型》、《医疗大数据》、《大数据处理技术》，计划将于今年8月正式出版。

其中，实验室负责编著《金融大数据》分册，聚焦大数据技术在金融领域的应用，结合典型应用，阐述大数据技术在国内金融领域的发展和现状，从大数据视角进行思考和探索，为金融创新、大数据人才培养，以及相关研究和应用提供有益支持。



### 与虹口区金融办洽谈合作建立上海对冲基金研究中心

2014年6月4日，经过长达3个月的多次洽谈，实验室常务副主任陈云教授与上海市虹口区金融办主任葛平局长最终达成共识，双方将在虹口区人民政府与上海财经大学签订的战略合作框架协议的基础上，合作建立上海对冲基金研究中心。

虹口区人民政府和上海财经大学于2013年6月签订战略合作框架协议，主要在三个方面开展战略合作：一、加快区域经济转型发展，助推虹口金融服务业发展和创业型城区建设；二、推动教育综合改革发展，实现资源共享；三、加强人才互动和交流。基于该合作框架协议，为了更好地建设和发展虹口对冲基金产业园区，双方拟合作成立上海对冲基金研究中心。

上海对冲基金研究中心将紧密围绕国家金融改革创新和上海国际金融中心建设的战略发展目标，针对对冲基金行业的前沿问题和关键技术进行研究和攻关。基于国外成功经验，通过学科交叉和产学研合作，在政策、方法技术、专业人才等方面为对冲基金产业园提供支持，致力于形成国内对冲基金科学研究、咨询服务和人才培养的高地。

#### 上海对冲基金园区

上海市虹口区在近年来区域金融集聚跨越式发展的基础上，借中国（上海）自由贸易区成立的东风，启动了对冲基金园区的建设工作。2013年10月18日上海对冲基金园区在虹口北外滩正式开园、投入运作，首批入驻企业有12家对冲基金机构。截至2014年1月，已有30多家对冲基金企业入驻，机构管理资产规模已达到100亿人民币，同时，仍有近40家企业正在办理入驻手续。据区金融办预计，到2014年底，园区内对冲基金资产管理总规模将有望超过200亿元。

上海对冲基金园区以向入驻对冲基金提供全面、专业、高效的服务为主要目的，在园区内着力构建一个由银行、券商、基金公司、金融数据服务商、第三方销售机构等组成的优良的金融生态体系，确保有效降低入驻企业的经营成本，营造有利于对冲基金业务开展的经营、生活环境。同时，入驻企业还将在引导基金、人才激励、财税扶持、物业租金、医疗保障、交通设施等诸多方面，享受一系列由市、区两级政府提供的优惠扶持政策。

### 申银万国期货有限公司来访洽谈合作事宜

2014年6月12日,申银万国期货有限公司副总经理袁万勇、研究所负责人何小明等来访实验室,实验室常务副主任陈云教授、副主任谢斐等负责接待,双方就协同合作事宜进行洽谈。

实验室常务副主任陈云教授首先介绍了实验室的发展情况、研究团队、已有成果等基本情况;接着,申银万国期货有限公司副总经理袁万勇先生和研究所负责人何小明先生分别就申银万国期货及其金融创新实验室(产品中心)的情况做简要介绍。随后,双方就今后可能合作的领域进行探讨,一致认为可在策略设计与开发、智能决策支持平台与工具的研发、金融创新产品的测试与评估等方面开展合作研究,此外还可在人才培养、资源共享、学术交流等多方面展开合作。

### 申银万国证券有限公司来访洽谈联合培养博士后事宜

2014年6月25日,申银万国证券有限公司博士后科研工作站负责人朱曦博士、蒋将博士来访实验室,实验室常务副主任陈云教授、研究人员俞立、张超等负责接待,双方就联合培养博士后事宜进行洽谈。

首先,陈云教授就实验室研究团队、研究项目及博士后培养的相关情况做简单介绍;朱曦博士随后就申银万国博士后科研工作站的设立及培养情况进行了介绍。双方均认为博士后流动站和企业工作站联合培养博士后对博士后的研究和成果转化均具有重要意义,对今后校企双方在科学研究上的合作也具有推动作用。之后,双方就博士后联合培养的培养方式、职责分工等细节进行讨论,并最终商定,今年将启动一名数据挖掘和精准营销方向的博士后进行联合培养。

### 申银万国

申银万国证券是国内最早的一家股份制证券公司,也是目前国内规模最大、经营业务最齐全、营业网点分布最广泛的综合类证券公司之一。

申银万国期货是申银万国证券控股子公司,具有商品期货经纪业务、金融期货经纪业务资格,目前在证券控股期货公司中位列前茅。

### 2014 金融推进中国（上海）自由贸易试验区发展论坛

2014年5月31日，由上海国际金融中心研究院、中国（上海）自由贸易试验区协同创新中心共同主办，上海市金融信息技术研究重点实验室、全通上海金融谷、上海财经大学金融学院参与协办的“2014 金融推进中国（上海）自由贸易试验区发展论坛”在上海财大豪生酒店3楼会议厅举行。

论坛由上海国际金融中心研究院的院长助理马文杰副教授主持，原上海市副市长、上海服务业联合会会长、上海国际金融中心研究院名誉院长周禹鹏先生，上海财经大学副校长、上海国际金融中心研究院院长蒋传海教授，上海市教委科技发展中心主任兼书记许开宇女士致欢迎辞。上午，中国（上海）自由贸易试验区财政和金融服务局曹艳文副局长，平安银行冯杰副行长，Erskinomics Consulting Pty Ltd 咨询专家 Jeff Schubert、上海国际金融中心研究院协同研究专家 Jeff Schubert 先生，上海国际金融中心研究院副院长丁剑平教授就金融推进上海自贸区发展进行主旨发言。

下午，会议由上海国际金融中心研究院执行院长赵晓菊教授和院长助理谈儒勇副教授共同主持，上海社会科学院世界经济研究所张幼文所长，上海自贸区研究协调中心徐明棋秘书长，上海金融谷董事长林振雄先生，上海交通大学中国金融研究院费方域副院长，上海财经大学法学院宋晓燕教授，上海对外经贸大学法学院黄洁副院长，上海国际仲裁中心副主任兼秘书长闻万里，银监会创新监管部、银证保协作监管处陈胜处长，上海市金融服务办公室综合协调处崔远见处长、申银万国期货有限公司副总黄海生先生、上海国际金融中心研究院龚仰树教授、陈利平副教授、栗芳副教授等专家依次就“金融推进中国（上海）自由贸易试验区发展”以及“上海国际金融中心建设”问题发言，全体参会专家、学者、学生和媒体记者就相关问题展开研讨。

本次“2014 金融推进中国（上海）自由贸易试验区发展论坛”及其在论坛中交流的研究成果，是上海财经大学通过高等院校的知识服务平台，以国际国内合作的方式研究中国重大战略问题的一次很好的尝试和展示，是通过整合国际国

内研究资源，与国内外研究人民币国际化方面的著名研究机构和权威学者一起，探索开展国内外、高水准、多角度、多维度、重协同、求创新的决策咨询研究模式创新的有益的尝试。中外专家学者在本次论坛上发布和交流的研究成果，将在推进自贸区建设和上海国际金融中心建设进程中发挥重要和深远的影响。上海国际金融中心研究院今后将继续与国内外研究机构和金融机构的专家学者开展协同研究，更好的发展高校知识服务平台在推进上海国际金融中心建设、自贸区建设、人民币国际化、金融市场发展和实施国家重大战略目标过程中的决策咨询作用。



### 第二届亚洲定量金融会议 (AQFC)

2014年6月19日至21日,第二届亚洲量化金融会议(AQFC)在山东大学威海校区举行,这次会议致力于提供在亚洲范围内定量金融领域的最新研究进展及动态,促进亚洲定量金融学的研究。本次会议由山东大学齐鲁证券金融研究院主办,威海校区数学与统计学院协办,会议主题包括风险测度、倒向随机微分方程、内幕交易、金融信息、随机控制及其在投资组合选择中的应用、流动性模型、定价和对冲、非线性期望理论等。实验室研究团队受邀参加此次会议,研究人员任丽颖等代表出席。

会议包括6场大会报告,18场邀请报告,来自美国、韩国、新加坡、香港以及内地的学者参加会议。其中戴民(新加坡国立大学)、Jerome DETEMPLE(美国波士顿大学)、陈松蹊(北京大学)、Hyeung Keun KOO(韩国亚洲大学)、Steven KOU(新加坡国立大学)、肖志杰(美国波士顿学院)等学者分别作了大会报告和邀请报告,展示了自己的最新研究成果。报告涉及动态噪声的理性预期均衡、关于资本利得税和低利率 Merton 问题的渐近解、从债券价格中提取短期利率和市场价格、自我融资约束下的最优消费和投资组合、对股票和期权利用经验似然方法已获得危机中的期权信息、通过分位数信息的最优组合实现有效回归等多个方面的问题。

实验室研究人员任丽颖等参加了为期三天的会议,听取了精彩的大会报告和邀请报告,并与与会专家学者进行了深入交流,收益颇多,尤其对风险测度、倒向随机微分方程、内幕交易、金融信息、随机控制及其在投资组合选择中的应用、流动性模型、定价和对冲、非线性期望理论等有了更全面更深入的了解,对于实验室的科研工作有了新的思路和想法。

## 开放活动

---

### 2014 年上海科技周活动——重点实验室开放活动

2014 年 5 月 17 至 26 日,为期 10 天的 2014 年上海科技活动周在全市顺利举行。本届科普活动周分“触摸科技”、“乐享生活”、“放飞梦想”和“共创未来”4 个板块,汇集了全市 800 多场科普活动。科技周期间,全市 91 个研究机构 and 大学重点实验室也首次向公众开放。

我实验室作为上海市重点实验室之一,积极响应科委要求,于 5 月 20 日向市民开放。参与活动的市民在实验室相关人员的指引下参观了实验室,随后在副主任谢斐老师的讲解和指导下完成了“金融市场模拟实验”。

参与活动的市民来自不同的行业和领域,在实验室专家的讲解和指导下,通过点击鼠标,进入模拟的金融市场,并通过所有参与者的共同行为实验,了解到金融市场交易行为的规律所在,市民们均表示参与此次活动受益匪浅,并希望实验室今后可增加对外,特别是对公众的开放活动。



### 成功引进优秀研究人员和科研博士后

日前，经过实验室组织专家多轮面试和多层次考核，成功引进香港中文大学刘可伋博士作为实验室“特聘研究人员”，实验室研究队伍进一步充实。

刘可伋博士毕业于香港中文大学，获数学博士学位，主要研究领域是逆散射问题及相关经济优化问题。其拥有优秀的科研和教学能力，在数理统计和优化算法等领域具有坚实的学术研究基础，目前已完成高质量学术论文 5 篇，其中，SCI 1 区刊物一篇 (Inverse Problems)，SCI 2 区刊物一篇 (Applied Math and Computation)，国际著名刊物一篇 (Inverse Problems in Science and Engineering)。刘可伋博士已于 6 月底正式到岗，并迅速切入实验室已有项目研究工作中，将香港高校先进的科研和教学经验带入实验室，带入财大，成为重要的研究力量。

此外，依托实验室研究项目招收的科研博士后在经过重重筛选后，最终选拔出毕业于电子科技大学（985 高校）的应届博士徐振业。其具有信息技术、应用数学和金融学复合背景，符合实验室对于复合型人才的需求。徐振业博士后计划于 7 月到实验室报到。

### 《2015 年研究生招生简章》发布

日前，在校领导及相关部门支持下，实验室正式发布《2015 年上海市金融信息技术研究重点实验室研究生招生简章》。这是实验室作为科研平台，在探索跨学科、复合型研究生培养模式道路上踏出的重要一步。

2015 年实验室计划在“金融风险计量与控制”（金融硕士专业/金融数学与金融工程专业）、“金融智能决策支持”（金融信息工程专业）两个方向招收硕士、博士研究生，其主要研究领域为：1) 基于仿真和系统技术的金融制度和金融监管，2) 网络金融和金融产品创新，3) 金融市场风险管理，4) 基于海量数据挖掘的智能决策支持。

实验室的研究生培养，将与科学研究、社会服务密切结合。以多学科交叉融合的研究和应用为特色，以理论应用能力与创新能力的培养与锻炼为核心，以实验室与金融机构、企业合作建立的“产学研”基地为支撑，致力于培养符合行业、国家发展需求的具有金融、信息交叉领域背景的复合型高端人才。

**强调多学科交叉融合。**研究生培养贯彻实验室“跨学科”的理念，在课程安排上强调多学科交叉融合，利用各大学院的优秀师资力量和实验室的研究团队，设置课程既包括金融类专业课程，又包括数据挖掘、金融统计研究等信息技术、数理统计类专业课程

**采用导师团队联合培养方式。**由数名来自不同专业领域的教师组成导师团队来负责研究生的培养，有利于拓展思维、学科交融、团队合作。目前实验室的教师团队专业领域包含金融学、工商管理、管理科学与工程、数学、计算机科学等，可满足研究生跨学科培养的需求。

**以前沿问题研究为核心。**实验室已与众多业内领先企业签定战略合作协议，如上海金融期货信息技术有限公司、摩根士丹利华鑫证券公司、国泰安信息技术有限公司等，同时也承担多项国家级、省部级和横向合作重大项目。这些均可为研究生开展前沿研究与创新，进行应用实践提供帮助与支持。

**提供软硬件支撑平台。**实验室的丰富数据库资源，以及各类分析与仿真工具，

如 WRDS 系列数据库、彭博数据系统终端设备、天相投资分析系统、CSMAR 系列数据库、Informatic、MicroStrategy、SAS、Weka 等数据仓库和数据挖掘工具、飞马金融期货仿真平台等，都向研究生开放使用，并由教师指导和培训，支撑研究生创新实践能力的培养。