

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.7 2014.7-9

2014年10月24日

目录

科研动态	1
《SPAN系统风险矩阵计算参数设置方法研究及分析》项目完成验收	1
产业合作	2
与上海对冲基金园区战略合作备忘录签约仪式成功举行	2
上海对冲基金研究中心揭牌仪式，2014 中国对冲基金高峰论坛成功举办	4
EMC公司代表来访实验室	6
学术交流	7
美国斯坦福大学管理科学与工程系主任一行来访上财及实验室	7
受邀参加中国大数据国际高峰论坛	8
【金融大数据讲座系列之一 —— 情绪金融学及其应用】成功举行	9
讲座报告：朝阳永续私募基金数据库研发团队	10
2014-2015 年实验室Seminar 正式启动	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
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>

《SPAN 系统风险矩阵计算参数设置方法研究及分析》项目完成验收

2014 年 10 月 21 日，研究项目《SPAN 系统风险矩阵计算参数设置方法研究及分析》完成项目验收。

实验室研究人员任丽颖等一行前往中金所技术公司，进行项目验收汇报。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项目研究成果表示了肯定。

该项目于今年 4 月立项。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。该项目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。其研究成果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。

与上海对冲基金园区战略合作备忘录签约仪式成功举行

2014年9月26日下午，上海对冲基金园区与上海市金融信息技术研究重点实验室战略合作备忘录签约仪式在上海财经大学隆重举行。出席签约仪式的领导和嘉宾有上海市虹口区金融服务办公室主任葛平先生，金融服务中心副主任解文才先生；上海财经大学副校长、上海市金融信息技术研究重点实验室主任蒋传海教授，实验室常务副主任陈云教授、副主任韩冬梅教授，以及实验室研究团队代表郝晓玲副教授、俞立副教授等。签约仪式由实验室常务副主任陈云教授主持。

葛平主任首先代表虹口区金融服务办和上海对冲基金园区，对此次与实验室达成战略合作表示诚挚的感谢。之后，葛平主任简要介绍了虹口区定位金融服务的发展方向，以及上海对冲基金园区成立一年以来的迅速成长和显著效果，并期待双方在今后的合作中优势互补、深入合作，为园区的发展、以及整个对冲基金行业的发展贡献力量。

随后，蒋传海副校长对葛平主任一行的到来表示欢迎与感谢，并向其简要介绍了上海财经大学及上海市金融信息技术研究重点实验室的发展概况。蒋传海副校长指出，上海财经大学在2013年就与虹口区人民政府签订有战略合作框架协议，本次与实验室签订战略合作备忘录，是校区合作的进一步落实和深入，希望双方可以共同建立长期稳定的合作。



最后，在热烈友好的气氛中，双方签署了战略合作备忘录，将合作设立上海

对冲基金研究中心，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，全面支持和服务上海对冲基金园区的建设，推动我国对冲基金行业，乃至整个金融行业的快速、健康发展。



上海对冲基金园区

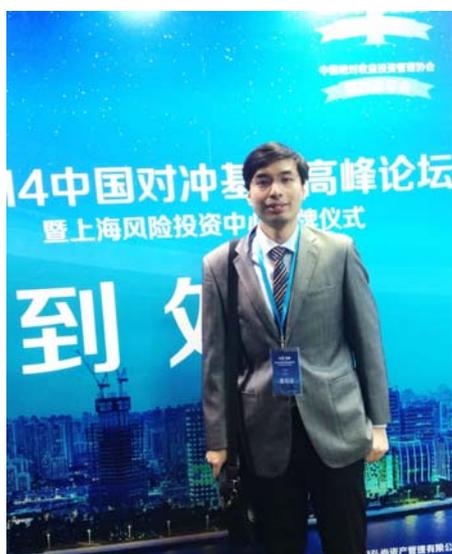
上海市虹口区在近年来区域金融集聚跨越式发展的基础上，借中国（上海）自由贸易区成立的东风，启动了对冲基金园区的建设工作。2013年10月18日上海对冲基金园区在虹口北外滩正式开园、投入运作，首批入驻企业有12家对冲基金机构。截至2014年1月，已有30多家对冲基金企业入驻，机构管理资产规模已达到100亿人民币，同时，仍有近40家企业正在办理入驻手续。据区金融办预计，到2014年底，园区内对冲基金资产管理总规模将有望超过200亿元。

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。

上海对冲基金研究中心揭牌仪式

2014 中国对冲基金高峰论坛成功举办

2014 年 10 月 18 日，由上海对冲基金园区与上海市金融信息技术研究重点实验室（上海财经大学）共同设立的“上海对冲基金研究中心”在虹口北外滩正式挂牌，虹口区区长曹立强、上海财经大学副校长黄颖，为研究中心揭牌。实验室常务副主任陈云、副主任谢斐出席揭牌仪式。



当天，“财富管理——2014 中国对冲基金高峰论坛”同时举行，论坛由上海对冲基金园区主办，中国绝对收益投资管理协会、上海对冲基金俱乐部、上海同安投资管理有限公司和上海弘尚资产管理有限公司承办，来自海内外的超过 300

家银行、证券市期货以及知名对冲基金等金融机构参会，总人数超过了 600 人。

实验室常务副主任陈云教授、副主任谢斐受邀出席论坛，陈云教授在下午举行的分论坛“量化对冲基金与高净值人士财富管理”专题中做主题演讲。



EMC 公司代表来访实验室

2014年10月14日 EMC（易安信）公司中华区副总裁郭华先生，客户技术主管杨宪洪先生，商业系统部总经理毕经林先生，销售经理简波先生来访实验室，实验室常务副主任陈云教授接待。

陈云教授首先介绍了实验室情况，包括建设目标和任务，以及在科学研究、人才培养、产业合作以及支撑环境的开展情况；EMC 中华区副总裁郭华先生介绍了 EMC 公司在信息存储及管理产品、服务和解决方案等方面的情况。

随后，双方就合作内容进行了讨论，并最终达成共识，将在大数据平台搭建、专业培训与学术交流、国内外金融大数据应用案例分享与展示、以及金融大数据合作研发这四大方面展开深入合作。

美国斯坦福大学管理科学与工程系主任一行来访上财及实验室

2014年9月30日，美国斯坦福大学管理科学与工程系系主任 Peter Glynn 教授一行来访上海财经大学。在会间樊丽明校长前，Peter Glynn 教授一行与包括实验室在内的我校院系及科研机构代表负责人进行了座谈交流，就相关合作意向及计划进行了深入探讨。陪同来访的有斯坦福大学管理科学与工程系 Kay Giesecke 副教授及职业发展中心中国项目主任赵春梅。

实验室常务副主任陈云教授受邀出席座谈会，向 Peter Glynn 教授一行介绍了实验室的成立背景、建设目标，特别是在金融信息领域的科学研究、人才培养和社会服务方面的资源优势与已有成果。会后，Kay Giesecke 副教授受陈云教授邀请来到实验室，经过双方长时间的进一步商讨，最终就科学研究和人才培养等方面的合作达成初步意向。

斯坦福大学 (Stanford University) 是美国著名私立大学，始建于 1885 年，位于加利福尼亚州，临近旧金山，占地 35 平方公里，是美国面积第二大的大学。斯坦福大学在 2014 年《美国新闻和世界报导》(USNews) 最新美国大学综合排名第 5 名，2014 年 QS 世界大学排名世界第 7 名，2014 年泰晤士高等教育世界大学排名世界第 4 名，被认为是世界上最杰出的大学之一。

受邀参加中国大数据国际高峰论坛

2014年8月22日-24日，由中科院深圳先进技术研究院、中国量化投资研究院、复旦大学管理学院、《上海证券报》社、Datawatch Corporation 共同主办，中科院深圳先进技术研究院-国泰安金融大数据研究中心、复旦大学统计学系、深圳市国泰安信息技术有限公司、深圳市中宽信息咨询有限公司联合承办，TalkingData 作为支持单位的“2014 中国大数据国际高峰论坛”在上海隆重召开。实验室研究团队张超等一行受邀参加峰会。

此次峰会为国内外的大数据产业界、学术界和政策制定方之间搭建一个沟通交流的国际化平台，100 多位世界顶尖的大数据产业界专家和学术界知名学者，与 400 多位来自 IT、金融、教育、医疗和政府代表出席峰会，共同探讨大数据产业发展以及大数据产品和工具等前沿话题，分享大数据智慧，探索各行业之间面临的数据分析应用问题的解决途径。

【金融大数据讲座系列之一 -- 情绪金融学及其应用】成功举行



由实验室主办“金融大数据讲座系列之一 -- 情绪金融学及其应用”于2014年10月17日晚在实验室会议厅成功举办。本次主讲人是伦敦大学，吴海丽博士。



讲座报告：朝阳永续私募基金数据库研发团队

2014年10月10日，上海朝阳永续信息技术有限公司业务经理张雯瑶、产品经理姜金龙一行来访实验室，做有关私募基金数据库及指数化研究的讲座报告。实验室主要研究团队及研究生代表参加本次讲座报告。

报告结束后，实验室副主任谢斐与来访一行进行了短暂的洽谈，就双方后续在对冲基金指数方面的合作研究进行洽谈，并制定初步方案。

上海朝阳永续信息技术有限公司（简称：朝阳永续）成立于2003年，位于上海陆家嘴金融中心，是中国领先的上市公司盈利预测数据提供商、高端财富管理者的服务平台，也是中国金融人脉圈的卓越聚合者。朝阳永续私募数据库，获得了90%以上的超高主流市场占有率，其与兴业信托联合发布的“中国私募基金指数”（简称CISI），覆盖所有通过国内信托平台发行的证券投资类信托计划（即“阳光私募基金”）和所有证券公司发行的券商集合理财产品，完整、及时、客观地反映中国阳光私募行业和券商集合理财行业的平均收益变动状况。



学术交流

2014-2015 年实验室 Seminar 正式启动

2014 年 10 月 14 日起，由实验室策划并组织的内部学术 Seminar 正式启动。Seminar 旨在加强实验室内部的学术交流，涵盖实验室所有学术带头人、专职研究人员、兼职研究人员及特聘研究员，真正实现实验室跨学科、跨领域研究队伍的交叉融合。

下图为 10 月 14 日，实验室研究人员刘可伋博士，做有关《反散射问题介绍及创新算法》报告。

