

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.4 2013.11

2013年12月12日

目录

科研动态	1
2013年度实验室开放课题立项	1
《SPAN保证金模型计算方法研究》项目通过开题评审	2
合作基地	3
中金所技术公司与实验室商讨2014年度工作计划	3
合作基地	4
上海触锐信息技术有限公司与实验室签订校企战略合作协议	4
学术交流	5
陈云教授在“大数据技术与互联网金融”研讨会发表演讲	5
受邀参加第十一届机器学习及其应用研讨会	5
学术交流	6
“联合培训课程 I —— 金融期货市场”成功举办	6

联系我们

网址: <http://fitl.sufe.edu.cn>

联系地址: 上海市国定路777号育衡楼318室

邮政编码: 200433

联系人: 夏梦婕

联系电话: (021) 65902786

电子邮箱: xia.mengjie@mail.shufe.edu.cn

科研动态

2013 年度实验室开放课题立项

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，实验室于今年 8 月发布 2013 年开放课题申请指南。之后得到了校内外众多金融信息领域研究人员的关注，截止 10 月 20 日，共收到申请书 20 余份。

实验室于 10 月 31 日举行了 2013 年度开放课题专家评审会。根据专家组评审意见，实验室拟对以下 11 项开放课题立项资助：

序号	课题负责人	依托单位	课题名称
1	黄吉平	复旦大学	融资融券对股市风险的影响：真人实验和代理人模拟
2	骆建文	上海交通大学	供应链内部融资与运营策略研究
3	汪镭	同济大学	基于群体智能算法的中国金融期货交易数据分析
4	徐玉红	苏州大学	多维动态风险度量生成机制研究及风险控制
5	曹志广	上海财经大学 金融学院	自动化交易策略及参数体系设置研究
6	李科	上海财经大学 金融学院	融资融券制度与卖空策略的有效性
7	梁治安	上海财经大学 应用数学系	特殊有效投资组合理论与方法研究
8	韩冬梅	上海财经大学 信息管理与工程学院	基于金融大数据仓库的金融景气指数及预警监测关键问题研究-构建自由贸易区金融开放环境下的金融监管平台
9	张涛	上海财经大学 信息管理与工程学院	自动化交易策略系统构建及仿真数据分析
10	郝晓玲	上海财经大学 信息管理与工程学院	金融机构程序化交易风险治理策略研究
11	李艳红	上海财经大学 信息管理与工程学院	沪深 300 股指期货市场交易行为及自动化交易监管政策研究

《SPAN 保证金模型计算方法研究》项目通过开题评审

2013 年 11 月 27 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 保证金模型计算方法研究》进行开题评审。实验室常务副主任陈云教授、副主任谢斐、研究人员任丽颖、姜广、俞立、张超等一行前往中金所技术公司，进行项目开题汇报。

参与项目开题评审工作的专家评审组成员包括：中金所技术中心副总经理鲁继东、工程师郑永康、总经理助理黄海金、林惜斌博士，结算部邓云胜，期权部吕凯等多位中金所高层管理人员及行业专家。专家评审组对该项目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。

保证金控制是衍生品交易风险管理的重要组成部分，SPAN 是目前国际上最具有代表性且技术含量最高的保证金系统之一，主要针对期货及其相关的衍生品。本课题的研究将有助于我国衍生品交易所及监管机构深入剖析国际金融衍生品市场的运作模式和风险管理制度，探索适合我国金融市场的保证金控制体系，提高国内期货交易所的国际竞争力。该项目也是继今年 9 月成功立项的两个产学研项目后，实验室获得又一个重要的联合研究项目。



实验室研究人员做开题汇报



中金所专家评审组听取开题汇报

中金所技术公司与实验室商讨 2014 年度工作计划

2013 年 11 月 27 日，实验室常务副主任陈云教授、副主任谢斐等一行前往中金所技术公司，就双方 2014 年度工作计划与公司副总经理鲁继东、总经理助理黄海金、工程师郑永康、林惜斌博士等进行了商讨。

在今年已有的研究课题基础上，双方提出了 7 个后续研究方向，包括：《面向境内外自动化交易的监管对比研究》、《基于人工仿真技术的期货风险监管实证研究》、《SPAN 风险管理系统参数设置问题研究》、《SPAN 风险管理系统研究和原型系统开发》、《期权的市场风险评估问题研究》、《金融期货海量数据仓库关键技术研究 and 原型开发》。双方就后续课题的研究内容、研究投入、研究计划等相关问题进行了深入的讨论与交流。

最后，鲁继东副总经理和陈云教授均表示今年双方的合作很密切、很成功，之后将进一步加强合作，提高合作研究课题的深度与广度，同时开拓更多样化的合作模式，全面实现科学研究、人才培养和社会服务的校企战略合作。



双方就明年工作计划商谈

合作基地

上海触锐信息技术有限公司与实验室签订校企战略合作协议

2013年11月，实验室与上海触锐信息技术有限公司（以下简称“公司”）在上海财经大学签订校企战略合作协议。双方将共建“产学研”合作基地，在合作研究、人才培养、资源共享和学术交流等方面开展校企合作。

上海触锐信息技术有限公司是一家专注于为金融机构提供风险管理解决方案的金融服务公司，曾为中芬共同发展基金、上海浦东发展银行风控部门、建设银行资产管理子公司等提供专业的风险管理解决方案及系统软件，在金融风险管理领域拥有长足的经验和优势。

2013年11月29日，公司副总裁陈宏、高级咨询经理张元昊来访实验室，与实验室常务副主任陈云教授进行了商谈，就双方今后的合作模式达成共识，将紧扣市场前沿需求，以行业解决方案为目标，在相关模型、算法等关键技术方面进行合作研究。

随后，该公司还向实验室捐赠了20套 Risk Simulator 和 Real OptionsSLS 金融风险管理系统软件，作为金融风险管理系统研究和原型构建的软件支持。



公司方展示金融风险管理系统软件

陈云教授在“大数据技术与互联网金融”研讨会发表演讲

2013年11月15日，“大数据技术与互联网金融”研讨会在上海大智慧股份有限公司成功举行，包括上海交通大学高级金融学院副院长费方域教授、上海财经大学会计学院院长陈信元教授、信息管理与工程学院副院长韩冬梅教授、上海第二工业大学等多所高等院校的代表参与此次研讨会，就大数据技术应用在互联网金融的应用问题研讨交流。我实验室常务副主任陈云教授受邀参加，并发表重要演讲。

会议期间，交大高金院陈以增教授和我实验室陈云教授分别介绍了两方正在开展的相关研究课题，就大数据技术在金融行业，特别是互联网金融领域的应用实践和关键技术等阐述了各自观点，并与参会的专家学者们进行了深入交流。

随后，大智慧公司产品部副总经理洪榕先生介绍了公司目前在该领域的进展情况以及今后的发展规划，希望可以增加与高校的合作交流，通过产学研合作攻克关键技术，实现大数据技术在互联网金融领域的成功应用。

受邀参加第十一届机器学习及其应用研讨会

第十一届机器学习及其应用研讨会于2013年11月2-3日在复旦大学逸夫科技楼1楼报告厅举行。此次研讨会由复旦大学上海市智能信息处理重点实验室和计算机科学技术学院联合承办，大会主席张军平、高新波(西安电子科技大学教授)。会议期间共有12位机器学习及其应用领域的专家报告，27个学生和教师墙展交流以及多位专家所做的Top Conference Review。

实验室研究人员姜广、俞立、张超等参加了为期两天的研讨会，在听取了两天的精彩报告，尤其是最后的顶级会议回顾后，对大数据、机器学习等相关理论研究以及在移动商务、脑影像分析等方面的最新应用有了更为深入的理解。

“联合培训课程 I —— 金融期货市场” 成功举办

2013 年 11 月 19 日实验室与上海赛胜信息技术有限公司举办了第一次联合培训，邀请胜科金仕达数据系统（中国）有限公司期货产品部经理刘术杰在实验室进行关于金融期货市场的专业培训。

本次培训内容主要包含期货概论、期货市场的组织结构、期货品种与合约、期货交易制度、期货交易流程、期货公司实际业务流程等多方面内容，从期货交易的实务操作角度为实验室研究人员及学生进行了期货交易、结算、风险等方面的培训，增强了项目研发人员的专业知识储备。

培训持续了 2 个小时，之后参加培训的研究人员还与刘术杰经理及到场的其他公司方人员就一些核心问题进行了深入的探讨，双方都对这种形式的培训交流表示满意，并期待下一次培训。



刘术杰经理主持培训



实验室及校内师生参加培训