

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.5 2014.3

2014年4月8日

目录

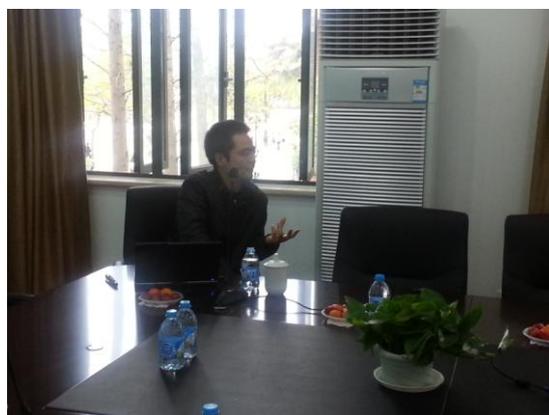
科研动态	1
复旦大学黄吉平教授做经济物理学领域学术报告	1
三项“产学研”课题完成课题验收	2
合作基地	3
中诚信资讯科技有限公司与实验室签订校企战略合作协议	3
学术交流	4
陈云教授受邀出席“云间论坛之大数据与互联网金融”	4
受邀参加“全国首届金融大数据战略与应用研讨会”	6
重要公告	7
实验室办公新址搬迁	7
2014年上海市金融信息技术研究重点实验室春季招聘	7

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>

复旦大学黄吉平教授做经济物理学领域学术报告

2014年3月28日，受实验室常务副主任陈云教授邀请，复旦大学黄吉平教授在我实验室做有关经济物理学的学术报告“实验室股票市场中的风险研究：融资效应”。黄吉平教授是实验室特聘研究员之一，长期在软物质物理领域开展研究工作，2006年起带领课题组成员开展经济物理方向的研究工作，受到学术界广泛认可。实验室专兼职研究人员及部分博士研究生参与此次学术报告。



黄吉平教授首先介绍了经济物理学的由来与发展，从物理学家为何做金融学或经济学研究开始，继而探讨物理学家做这些研究的优势和劣势、以及物理学家的研究范式。之后，重点介绍了经济物理学中的一个新方向——实验经济物理学，并以其所做的“实验室股票市场中的风险研究：融资效应”研究为例，展示了经济物理学研究思路与方法，对实验室专兼职研究人员和研究生开展跨学科研究，特别是实验研究，给予了启发和借鉴。

报告结束后，实验室常务副主任陈云、副主任谢斐、研究人员俞立、张超等还与黄吉平教授展开了热烈的讨论，就研究过程中的许多具体问题进行了深入探讨。

此次学术报告是实验室本学期第一场校外专家学术报告活动，取得了成功的反响。今后实验室将陆续邀请更多相关专家学者，尤其是金融信息跨学科领域的业界和学界人士，参与实验室的学术交流互动。

三项“产学研”课题完成课题验收

2013年下半年我实验室与上海金融期货信息技术有限公司（即“中金所技术公司”）在金融期货市场的风险管理方面开展广泛合作，三项“产学研”课题《海外自动化交易监管政策研究》、《自动化交易策略研究与仿真》、《金融衍生品资产组合保证金计算方法研究》通过开题评审，并立项研究。

日前，上述三项课题分别于2013年11月、2014年1月、2014年3月通过课题验收。研究成果对我国金融期货市场的风险管控具有重要的借鉴作用，获得了中金所高层领导的一致认可和高度重视。

课题名称	研究内容和成果
《海外自动化交易监管政策研究》	课题通过对包括美国、欧洲等地区在内的境外监管组织、交易所、自律机构的自动化交易监管政策法规和技术要求文件的梳理分析，从构建行业技术规范、加强交易所和会员端风险管理等方面，对国内自动化交易监管提出建议。
《自动化交易策略研究与仿真》	课题基于中国金融期货交易所全新开发的飞马（FEMAS）交易API以及与之对应的模拟大仿真系统，设计构建做市类、套利类等最具代表性的自动化交易策略；并在理论上进行规范化开发，构建合理的参数体系和分析构架；最后，将代码化策略在大仿真平台上进行仿真测试，基于实证研究分析对自动化交易的制度设计与市场监管提出建议。
《金融衍生品资产组合保证金计算方法研究》	课题梳理并分析金融衍生品市场风险度量方法国内外研究现状、发展现状、保证金系统计算原理，特别是对SPAN保证金系统的深入分析；完成SPAN算法原型系统的实现，并通过构造算例进行系统测试及精度分析；此外还研究了SPAN风险参数的构成特征及意义，为后续研究做准备。课题研究成果为在期权即将上市的金融衍生品市场建立科学有效的保证金制度提供了参考意见。

经讨论，2014年双方将继续开展以下四个课题的研究：1) 面向境内外自动化交易的监管对比研究，2) 基于人工仿真技术的期货风险监管实证研究，3) SPAN 风险管理系统参数设置和系统开发，4) 基于深度挖掘的股指期货异常交易行为分析和风险管控系统研发。

中诚信资讯科技有限公司与实验室签订校企战略合作协议

2014年1月，实验室与中诚信资讯科技有限公司（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。

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。公司以精准的数据、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。公司与证券监管机构、交易所、各大金融企业等机构均有良好的战略合作关系，在金融信息服务领域有着坚实的基础。

2014年3月起，中诚信资讯数据库正式向实验室开放，该数据库提供详细的金融、宏观、行业和资讯数据，包括中诚信独有的评级、理财及研报信息，为双方后续合作研究提供有力支撑。

中诚信数据服务平台
data.ccxe.com.cn

关于 我们 联系 我们 微博

基础数据

提供详细、及时的金融、宏观、行业及资讯等基础数据

用户登录 忘记密码?

帐号:

密码:

验证码: 987X

登录 IP登录 匿名

数据优势

- 海量数据**
提供研究、交易需要的各类金融、经济、行业、资讯海量数据，满足各类信息需求。
- 精准及时**
先进完善的数据资讯加工系统，自动化处理、实时监控及严格检测，最大程度保证数据准确和及时性。
- 专业设计**
权威专家顾问团队，行业经验丰富的
- 便捷应用**
便捷访问方式，直观数据预览，简单

新闻动态

- 中诚信资讯“世界银行数据...” [2014-02-25]
- 中诚信资讯“中国对外直接...” [2014-01-10]
- 中诚信资讯“P2P网贷数据库...” [2014-01-03]
- 中诚信资讯“资源环境数据...” [2013-12-06]
- 评级数据库“国家主权评级...” [2013-11-14]

陈云教授受邀出席“云间论坛之大数据与互联网金融”

2014年3月21日，由上海市云计算创新基地、上海大数据产业技术创新战略联盟等共同举办的云间论坛之“大数据与互联网金融”在上海云计算创新基地顺利召开。实验室常务副主任陈云教授、复旦大学软件学院副院长刘钢教授，上海市第二批千人计划专家吴昱先生，及多家网络金融服务公司的高层管理人员受邀出席，共同围绕“大数据之于金融领域”的创新与变革展开探讨。

论坛首先由主办方上海市云计算创新基地总经理杨苓女士致辞，之后由上海市第二批千人计划专家、运筹信息科技（上海）有限公司总裁吴昱先生、上海蒙融信息技术有限公司的总经理李刚先生、上海嘉银金融服务有限公司（你我贷）副总裁张光林先生分别以“大数据与其目前的商务运用”、“大数据与互联网时代下的金融资产管理平台建设”、“如何利用大数据来实现信用定价”为主题进行了精彩演讲。



随后的圆桌讨论环节，由我实验室常务副主任陈云教授、复旦大学软件学院副院长刘钢教授、宏源证券研究所计算机行业高级研究员姜国平先生主持、上海千人计划专家、上海融序计算机信息科技有限公司总经理范若愚、网贷之家联合创始人朱明春及先前的主题分享嘉宾共同围绕本期议题进行了精彩的观点交锋。陈云教授在期间提到：“目前互联网金融是有效地在推进金融的创新，并且间接助推传统金融行业的改革。对于互联网企业向金融领域辐射可能会出现监管盲区，银监会等监管部门将加快完善相关法律法规，使得金融创新在符合监管原则的基础之上不断发展。”

最后论坛在众多与会者此起彼伏地举手提问中意兴未尽的落下帷幕。



【背景介绍】

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。我实验室是上海大数据产业技术创新战略联盟首批成员单位之一。

受邀参加“全国首届金融大数据战略与应用研讨会”

2013年12月6日，“全国首届金融大数据战略与应用研讨会”在太原召开，相关领导以及来自全国的银行、证券、保险、科技界的专家学者200余人参加了研讨会。实验室研究团队受邀参加此次研讨会，姜广、张超等研究人员代表出席。

本次研讨会邀请了众多业界专家、知名金融企业高级管理人员及信息化软件服务商共聚一堂，探讨大数据技术在金融行业的应用与发展。国家信息中心副主任李凯、中国科学院大学副校长王颖、泰康人寿CIO刘大为、上海证券通信公司总经理助理道晟、兴业证券科技部总经理刘斌、上海农商银行CIO周衡昌、海通证券IT规划部副经理黄贤峰、国家信息中心李良博士等多位业界专家分别发表了精彩的专题报告。此外，中科院大学金融科技中心教授，原民族证券CIO马光悌主持了下午的嘉宾讨论环节，信达证券技术总监赵跃华、中信信托信息技术部总经理初壮以及部分发表主题报告的金融业嘉宾参与了讨论。

大数据被誉为继物联网、云计算之后又一次颠覆性的技术变革，已经引起各方面的高度关注。尤其是拥有大量的客户数据和交易数据的金融行业，在数据分析上积累了大量的实战经验，基本已具备向大数据时代跨越的基础，大数据在金融领域的应用无疑将成为金融行业新的增长点和发展方向



重要公告

实验室办公新址搬迁

我实验室于 2014 年 3 月 5 日正式搬迁至新办公区域：

上海市武东路 100 号，上海财经大学武东路校区，上海市金融信息技术研究重点实验室（近学生中心）

联系电话：65900944, 65902786



2014 年上海市金融信息技术研究重点实验室春季招聘

我实验室 2014 年春季招聘于 2014 年 3 月正式开始。

本次招聘面向全社会进行，计划招聘研究人员 1-2 名，科研博士后 3 名。

实验室诚邀优秀人才加入我们的队伍，具体招聘公告请参见实验室网站：

<http://fitl.sufe.edu.cn/?p=671>