

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.1 2013.5

2013年6月5日

目录

科研动态	1
课题一：面向大数据分析的金融期货高频交易风险监控系統	1
课题二：中小企业智能化网络融资平台的研发与应用	1
课题三：汽车供应链融资和风险监控	1
合作基地	2
实验室与上海金融期货信息技术有限公司签订协议共建产学研合作基地	2
市科委信息技术处处长繆文靖调研大数据技术在金融行业的应用	2
国际交流	3
实验室常务副主任陈云教授一行赴英国伦敦交流访问	3
学术论坛	5
“2013 人民币国际化全球论坛” 顺利召开	5
实验室一行参加“第六届全国金融数学与金融工程学科建设与学术研讨会”	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

实验室目前在研课题主要有以下三个：

课题一：面向大数据分析的金融期货高频交易风险监控系統

此课题是与上海金融期货信息技术有限公司（以下简称“技术公司”）合作课题，研究主要包括：1) 自动化交易对金融市场影响机制理论研究及其安全管理规范研究；2) 金融期货产品组合资产风控管理系统研究和实现。

2013年5月31日，技术公司林惜斌博士与实验室常务副主任陈云教授、副主任谢斐博士等进行了交流，就今后双方合作事宜进行了具体安排，双方就合作模式、任务分派、课题进度、资源配置等问题达成共识。林博士还参观了实验室的研究场所和系统环境。

课题二：中小企业智能化网络融资平台的研发与应用

课题主要研究内容包括：

- 1) 中小企业信息数据仓库的构建。
- 2) 中小企业智能化网络融资平台的开发、搭建和运行测试。
- 3) 中小企业智能化网络融资平台在各类金融机构的示范应用。

此课题是与上海财安金融服务有限公司合作，现已完成的工作如下：1) 确定研究框架，拟定分阶段课题完成目标和时间节点；2) 确定双方协作分工，并签订合作协议。3) 确定各个子任务的负责人、职责以及目标成果；4) 各项子任务的有序开展。

课题三：汽车供应链融资和风险监控

此课题主要涉及汽车供应链金融风险管控模型研究。拟与上汽财务金融有限公司合作，现正就合作相关事宜进行洽谈中。

合作基地

实验室与上海金融期货信息技术有限公司签订协议共建产学研合作基地

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资源优势，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。

注：上海金融期货信息技术有限公司(中金所技术公司)是由中国金融期货交易所全资设立的独立子公司，成立于2012年3月，前身为中金所下属部门技术中心，隶属于国务院证监会系统。公司定位于建立中国金融期货市场和信息技术领域的技术高地、人才高地和管理高地，是集信息技术规划、开发和运营服务于一体，以保障系统运行为核心，以服务于交易所为宗旨的现代IT公司，致力于打造健康规范、高效透明、功能齐备、技术先进的现代化金融衍生品交易市场。

市科委信息技术处处长繆文靖调研大数据技术在金融行业的应用

2013年5月24日，上海市科委信息技术处处长繆文靖一行到上海金融期货信息技术有限公司（以下简称“公司”）调研大数据技术在金融行业的应用情况，公司总经理史光伟、副总经理鲁继东和上海市金融信息技术研究重点实验室（以下简称“实验室”）常务副主任陈云教授一同接待了调研团队。

繆处长在史总、鲁总和陈教授的陪同下参观了中金所；随后听取了史总关于复杂事件处理、海量数据挖掘等大数据技术在金融期货行业应用的汇报，以及陈教授关于公司和实验室“产学研合作基地”研究进展的汇报。繆处长肯定了技术公司和实验室协同合作的研究模式，并对今后的工作提出了多项建议。

实验室常务副主任陈云教授一行赴英国伦敦交流访问

为提升上海市金融信息技术研究重点实验室、上海财经大学金融学院、上海国际金融中心研究院（SIIFC）的国际化水平，推动实验室与国外高校以及相关研究机构的合作，2013年4月30日至5月5日，实验室常务副主任陈云教授、实验室副主任谢斐、金融学院副院长何众志、上海国际金融中心研究院首席研究员丁剑平教授、上海财经大学证券研究中心主任金德环教授一行5人赴英国进行了交流访问。访问团先后访问了雷丁大学亨利商学院(Henley Business School, University of Reading)、伦敦玛丽女王大学财经学院（School of Economics & Finance, Queen Mary University of London）和伦敦金融城经济发展部（Economic Development Department, City of London）。



5月1日，访问团成员来到雷丁大学亨利商学院，分别对商学院下属的信息研究中心和ICMA（金融）研究中心进行了访问。信息研究中心的负责人刘科成教授和ICMA中心的Adrian Bell教授热情接待了访问团。双方就金融数据库、模拟系统与实验教学、双方的科研模式进行了讨论。Adrian Bell教授介绍了ICMA中心实验室主要研究方向以及实验室的发展路径。ICMA中心实验室主要研究方向为量化投资研究，研究重点在于交易策略、风险管理模型，同时该实验室与业界也保持着十分紧密的联系。陈云常务副主任认为这与我实验室的研究方向和运行模式非常相似，双方可以在这些方面增强联系与合作，互相学习，有利于双方的共同发展。

5月2日，访问团一行来到了伦敦玛丽女王大学。此前，玛丽女王大学代表

团分别于 2012 年 4 月和 13 年 3 月对财大进行了访问，何众志副院长代表金融学院参加了这两次会谈。此次访问玛丽女王大学是一次回访，进一步促进了两校的交流与合作。该校财经学院的对外联络主管 **Suraiya Seedat** 女士接待了访问团成员，介绍财经学院主楼（女王大楼）的悠久历史。随后访问团会见了财经学院分管教学的副院长 **Nick Vriend** 教授和 **Yioryos Makedonis** 高级讲师，双方就学术交流、合作办学等方面进行洽谈。



5 月 3 日下午访问团一行参观了伦敦金融城经济发展部，其负责人 **Peter Sissons**（司申特）热情接待了访问团。双方就人民币国际化和金融市场建设等问题展开交流。

本次赴英交流的访问单位涵盖了大学、研究中心、和政府机构，其中雷丁大学和玛丽女王大学与财大一直保持着多方面的交流与合作，伦敦金融城经济发展部是伦敦市负责制订经济金融政策的主要部门。此次访问讨论的议题完整深入，涉及到从实验室建设、学术交流、合作办学到人民币国际化的实施路径、金融市场的建设等多方面交流，完满地达到了访问的预期效果。实验室将会充分利用这次出访获得的信息及资源，保持与出访单位的联络与合作，发挥本次出访的最大效用，提升实验室研究、交流与合作的国际化水平。

“2013 人民币国际化全球论坛” 顺利召开

2013年5月26日，由上海财经大学上海国际金融中心研究院（SIIFC）与澳大利亚国际金融与监管中心（CIFR）共同主办，上海金融服务办指导，上海财经大学金融学院、上海市金融信息技术研究重点实验室协办的“2013 人民币国际化全球论坛”顺利召开。论坛由上海财经大学金融学院常务副院长、上海国际金融中心研究院执行院长赵晓菊教授主持，约有 150 位专家学者参加了此次论坛。我实验室作为协办方，由多位研究人员组团参加了论坛。



论坛于5月26日上午在上海财大豪生大酒店宴会厅拉开帷幕。上海财经大学周仲飞副校长、上海市教委科技处仓平处长、澳大利亚国际金融与监管中心专家 Geoff Weir、澳门金融管理局丁连星主席以及中国银行上海分行潘岳汉行长分别致辞。上海金融服务办公室主任方星海博士在论坛上作了重要讲话。此外，论坛还首次发布了由上海国际金融中心研究院与上海财大应用统计研究中心联合研发的 SIIFC—RCAS WED 全市场人民币汇率指数。

当日下午，来自上海市金融学会、上海国际集团金融发展研究院、中国银行国际金融研究所、交通银行发展研究部、广西大学东盟研究院、中国社科院国际经济与政治研究所、澳大利亚国库部、上海人民政府发展研究中心、上海社会科学院世界经济研究所、复旦大学金融研究院、华东师范大学金融研究院、上海国际金融中心、上海对外贸易学院等机构的专家学者参加了下午的研讨会，就“人民币国际化”问题展开深入的研讨。

实验室一行参加“第六届全国金融数学与金融工程学科建设与学术研讨会”

第六届全国金融数学与金融工程学科建设与学术研讨会于2013年6月1日至3日在上海金融学院举行。会议由上海金融学院和北京大学共同举办。实验室一行6人参加了周末两天的的研讨会。



此次会议致力于为广大学者和金融实务工作者搭建一个高水平的交流平台，探讨金融数学与金融工程学科建设、人才培养、学术研究成果及其在金融实务中的应用。彭实戈院士、白志东院士、郑伟安教授、吴冲锋教授、陈增敬教授、周勇教授、刘国祥教授、吴志坚教授、陈工孟教授、林健武教授、王过京教授等著名学者参加会议并作了重要报告。会议还邀请国内外学术界和业界的专家学者出席会议并做特邀报告。

与会期间，实验室常务副主任陈云教授、研究人员张超博士等与深圳国泰安信息技术有限公司的执行总裁王春雷、常务副主席冼嘉文、华东区域总经理曾晓斌、刘彩霞等进行了会谈，双方就未来在实验室平台搭建及课题研究方面的合作事宜进行了讨论，并确定了后续工作安排。

